

# 山西证券股份有限公司关于旗下指数基金编制方法 及查询路径的公告

为落实《公开募集证券投资基金运作指引第3号——指数基金指引》（2021年2月1日起施行）的规定，山西证券股份有限公司（以下简称“本公司”）旗下指数基金的相关指数编制方法及查询路径提示如下：

## 一、基金名称、标的指数及指数信息查询网址

基金名称：山西证券中证红利潜力交易型开放式指数证券投资基金

基金简称：山证红利

基金扩位简称：山证红利ETF

基金成立时间：2020年1月17日

标的指数：中证红利潜力指数

指数代码：H30089.CSI

指数编制公司：中证指数有限公司

指数编制方案：中证红利潜力指数从沪深市场中选取每股收益、每股未分配利润、净资产收益率等指标的综合排名靠前的50只上市公司证券作为指数样本，以反映沪深市场上市公司中分红预期大、分红能力强的上市公司证券的整体表现。

指数编制方法：

1、样本空间：中证全指指数的样本空间中满足以下条件的上市公司证券：

（1）过去3年连续现金分红，且上市公司当年分配的现金红利与年度归属于上市公司股东净利润之比不低于30%；

（2）过去一年的日均总市值排名在前80%；

（3）过去一年的日均成交金额排名在前80%。

2、选样方法

（1）对样本空间内的证券，计算其每股收益、每股未分配利润和净资产收益率，并将上述指标分别由高到低排名，将三个指标排名相加作为证券的综合排名；

(2) 对样本空间内证券，选取综合排名前 50 的证券作为指数样本。

### 3、指数计算

指数计算公式为：

报告期指数=报告期样本的调整市值/除数×1000

其中，调整市值=Σ(证券价格×调整股本数×权重因子)。调整股本数的计算方法、除数修正方法参见计算与维护细则。权重因子介于 0 和 1 之间，以使单个样本权重不超过 15%。

指数信息查询网址：

<http://www.csindex.com.cn/zh-CN/indices/index-detail/H30089>

## 二、其他需要提示的事项

1、投资者可通过本公司的客服热线或网站咨询有关详情：

客服电话：95573

公募业务网址：<http://publiclyfund.sxzq.com:8000>

2、风险提示：

本公司承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。投资者投资于本公司管理的基金时应认真阅读基金合同、招募说明书等法律文件及其更新，投资与自身风险承受能力相适应的基金。敬请投资者注意投资风险。

特此公告。

山西证券股份有限公司

2021年2月2日