

指数修订公告

为增强指数可投资性，深圳证券信息有限公司决定对存量指数进行修订。主要修订内容如下：

国证国企红利低波动率指数。一是指数名称和简称分别修订为国证国企红利低波动率指数和国企红利低波，代码修订为 980139；二是选样空间修订为公司属性为国企的 A 股和蓝筹企业发行的存托凭证；三是选样方法修订为首先剔除选样空间最近一年日均成交金额排名位于后 20% 的证券，其次剔除最近三年未连续现金分红、最近一年股利支付率为负、最近三年现金分红复合增长率非正的证券，然后选取过去三年的平均现金股息率较高的 150 只证券，最后选取最近一年波动率较低的 50 只证券构成指数样本；四是样本调整规则修订为季度定期调整且每次样本调整数量不超过样本总数的 30%；五是权重设置规则修订为根据样本过去三年平均现金股息率/过去一年波动率计算初始权重，同时使单只样本在每次定期调整时的权重不超过 10%，单个国证一级行业的样本权重之和不超过 30%。

本次修订将于 2026 年 3 月 26 日实施。修订后的编制方案见国证指数网（www.cnindex.com.cn）。

特此公告。

深圳证券信息有限公司

2026年3月19日