

中证港股通高股息投资指数编制方案

中证港股通高股息投资指数从符合港股通条件的香港上市公司证券中选取 30 只流动性好、连续分红、股息率高的上市公司证券作为指数样本，采用股息率加权，以反映港股通范围内连续分红且股息率较高的上市公司证券的整体表现。

一、指数名称和代码

指数名称：中证港股通高股息投资指数

指数简称：港股通高股息

英文名称：CSI Hong Kong Connect High Dividend Yield Investment Index

英文简称：HK Connect HDY

指数代码：930914（港元）/930915（人民币）

二、指数基日和基点

该指数以 2014 年 11 月 14 日为基日，以 3000 点为基点。

三、样本选取方法

1、样本空间

中证香港 300 指数样本中符合港股通条件的证券且过去三年连续现金分红，每年现金股息率均大于 0 的证券。

2、选样方法

- （1）剔除样本空间内过去一年日均成交金额低于 5000 万港元的证券；
- （2）对样本空间内剩余证券，计算其过去三年的平均现金股息率并由高到

低排名，选取排名前 30 的证券作为指数样本。

四、指数计算

指数计算公式为：

$$\text{报告期指数} = \frac{\text{报告期样本的调整市值}}{\text{除数}} \times 3000$$

其中，调整市值 = $\sum(\text{证券价格} \times \text{调整股本数} \times \text{权重因子} \times \text{汇率})$ ，汇率、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，以使样本采用股息率加权。

五、指数样本和权重调整

1、定期调整

指数样本每年调整一次，样本股调整实施时间为每年 12 月的第二个星期五的下一交易日。

权重因子随样本定期调整而调整，调整时间与指数样本定期调整实施时间相同。在下一个定期调整日前，权重因子一般固定不变。

2、临时调整

特殊情况下将对指数进行临时调整。当样本退市时，将其从指数样本中剔除。样本公司发生收购、合并、分拆等情形的处理，参照计算与维护细则处理。当港股通范围发生变动导致样本不再满足港股通资格时，将进行相应调整。