

中证红利潜力指数编制方案

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。

一、指数名称和代码

指数名称：中证红利潜力指数

指数简称：红利潜力

英文名称：CSI Dividend Potential Index

英文简称：CSI Dividend Potential

指数代码：H30089

二、指数基日和基点

该指数以 2005 年 12 月 30 日为基日，以 1000 点为基点。

三、样本选取方法

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) 过去三年连续现金分红，且上市公司过去一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。

四、指数计算

指数计算公式为：

$$\text{报告期指数} = \frac{\text{报告期样本的调整市值}}{\text{除数}} \times 1000$$

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，以使样本采用股息率调整后的自由流通市值加权，单个样本权重不超过 15%。

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，样本调整实施时间为每年 12 月的第二个星期五的下一交易日。在新一轮样本调整中，首先将不满足以下条件的原样本依次剔除：

(1) 过去一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落在中证全指指数的样本空间的前 90%；

(3) 过去一年的日均成交金额排名落在中证全指指数的样本空间的前 90%。

满足以上三个条件的原样本仍具有新一期样本空间的资格。

每次调整的样本比例一般不超过 20%，除非因不满足过去一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% 被首先剔除的原样本证券超过了 20%。

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。