

中证香港海外高股息指数编制方案

中证香港海外高股息指数从符合港股通条件的非内地港股中选取 30 只流动性好、连续分红、股息率高的股票作为样本股，采用股息率加权，以反映香港市场连续分红且股息率较高的非内地企业股票的整体表现。

一、 指数名称和代码

指数名称：中证香港海外高股息指数

指数简称：香港海外高股息

英文名称：CSI Hong Kong Overseas High Dividend Yield Index

英文简称：HK Overseas High Dividend Yield

指数代码：930907（港币）/930908（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

中证香港海外高股息指数的样本空间由满足以下条件的港股构成：

（1）中证香港 300 样本股中符合港股通条件的股票；

（2）过去三年连续现金分红且每年现金股息率均大于 0。

2、 选样方法

（1）剔除样本空间中内地概念企业，其中内地概念企业为符合以下条件之一的证券：

a) 注册地在中国大陆；

- b) 公司营运中心在中国大陆;
- c) 公司主营收入 50% 以上来自中国大陆;

(2) 对 (1) 中剩余股票计算其过去三年的平均现金股息率并降序排列, 选取排名前 30 的股票作为指数样本股。

四、 指数计算

中证香港海外高股息指数计算公式为:

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

其中, 调整市值 = $\sum(\text{股价} \times \text{调整股本数} \times \text{权重因子} \times \text{汇率})$, 权重因子 = 股息率 / ($\text{股价} \times \text{总股本} \times \text{自由流通靠档比例}$)。汇率采用汤森路透综合汇率报价中间价。

五、 指数样本和权重调整

1、 定期调整

中证香港海外高股息指数的样本股每年调整一次, 样本股调整实施时间为每年 12 月的第二个星期五收盘后的下一交易日。

权重因子随样本股定期调整而调整, 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样本进行临时调整。当样本股暂停上市或退市时, 将其从指数样本中剔除。样本股公司发生收购、合并、分拆、停牌等情形的处理, 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股不再满足港股通资格时, 将进行相应调整。