

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，以反映港股通范围内连续分红且股息率较高的股票整体表现。

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（港币）/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

中证港股通高股息投资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）剔除样本空间内过去一年日均成交金额低于 5000 万港币的股票；

（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

中证港股通高股息投资指数计算公式为：

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

其中，调整市值 = $\Sigma(\text{股价} \times \text{调整股本数} \times \text{权重因子} \times \text{汇率})$ ，权重因子 = 股息率 / (股价 \times 总股本 \times 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

中证港股通高股息投资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。