

中证建信理财粤港澳大湾区红利低波指数编制方案

中证建信理财粤港澳大湾区红利低波指数从沪港深三地上市的粤港澳大湾区公司中选取 100 家流动性好、分红水平相对较高的公司股票作为指数样本股，按照自由流通市值、最近三年平均股息率和最近一年日收益率标准差倒数 1:1:1 进行加权，以反映沪港深三地上市的粤港澳大湾区公司中分红水平高且波动率低的股票的整体表现。

一、指数名称和代码

指数名称：中证建信理财粤港澳大湾区红利低波指数

指数简称：大湾区红利低波

英文名称：CSI CCB Wealth Management Greater Bay Dividend Low Volatility Index

英文简称：Greater Bay Div Low Vol

指数代码：931345（人民币）/931346（港币）

二、指数基日和基点

该指数以 2014 年 12 月 31 日为基日，以 1000 点为基点。

三、样本选取方法

1、样本空间

中证建信理财粤港澳大湾区红利低波指数的样本空间由中证全指和中证港股通综合指数样本股中属于粤港澳大湾区的股票组成，这里的粤港澳大湾区股票是指符合下列三个条件之一的证券：（1）公司注册地在粤港澳大湾区；（2）公司营运中心在粤港澳大湾区；（3）公司主营业务收入 50% 以上来自粤港澳大湾区。

其中，粤港澳大湾区指的是由广州、佛山、肇庆、深圳、东莞、惠州、珠海、

中山、江门 9 市和香港、澳门两个特别行政区形成的城市群。

2、选样方法

该指数按照以下方法选择经营状况良好、无违法违规事件、财务报告无重大问题的公司股票：

(1) 对样本空间内的 A 股，按照过去一年日均成交金额由高到低排名，剔除排名后 20% 的股票；对样本空间内的港股，剔除过去一年日均成交金额低于 1000 万港币的股票；

(2) 剔除过去三年没有分红的股票；

(3) 对上述剩余股票，按照过去一年日均总市值由高到低排序，选取排名靠前的 100 家公司股票组成指数样本。

四、指数计算

中证建信理财粤港澳大湾区红利低波指数计算公式为：

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

其中，调整市值 = $\sum(\text{股价} \times \text{调整股本数} \times \text{权重因子} \times \text{汇率})$ 。权重因子介于 0 和 1 之间，以使指数样本权重同时满足：隶属于粤港澳三地的股票权重设定参照区域 GDP 规模，自由流通市值、过去三年平均股息率和最近一年日收益率标准差倒数按 1:1:1 加权参与指数计算，个股权重不超过 10%。调整股本数的计算方法、除数修正方法以及汇率参见计算与维护细则。

五、指数样本和权重调整

1、定期调整

中证建信理财粤港澳大湾区红利低波指数的样本股每半年调整一次，样本股调整实施时间分别是每年 6 月和 12 月的第二个星期五的下一交易日。

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。