

沪深 300 红利指数编制方案

沪深 300 红利指数从沪深 300 指数样本中选取股息率较高的 50 只上市公司证券作为指数样本，反映沪深 300 指数样本中高股息率证券的整体表现。

一、指数名称和代码

指数名称：沪深 300 红利指数

指数简称：300 红利

英文名称：CSI 300 Dividend Index

英文简称：CSI 300 Dividend

指数代码：000821

二、指数基日和基点

该指数以 2004 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

沪深 300 指数样本中满足以下条件的沪深 A 股和红筹企业发行的存托凭证：

- (1) 过去三年连续现金分红；
- (2) 过去三年股利支付率均值和过去一年股利支付率均大于 0 且小于 1。

2、选样方法

对样本空间内证券，按照过去三年平均现金股息率由高到低排名，选取排名前 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 = $\sum(\text{证券价格} \times \text{调整股本数} \times \text{权重因子})$ 。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加权，单个样本权重不超过 10%。

五、指数样本和权重调整

1、定期调整

指数样本每半年调整一次，样本调整实施时间分别为每年 6 月和 12 月的第二个星期五的下一交易日。每次调整的样本比例一般不超过 20%。

在年中定期调整时，调出沪深 300 指数的样本同时也调出该指数，并按照上年末定期调整时的股息率排名依次选取仍在沪深 300 指数中的证券进入该指数。

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。