

## 中证 1000 红利指数编制方案

中证 1000 红利指数从中证 1000 指数样本中选取股息率较高的 100 只上市公司证券作为指数样本，以反映中证 1000 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：中证 1000 红利指数

指数简称：1000 红利

英文名称：CSI 1000 Dividend Index

英文简称：CSI 1000 Dividend

指数代码：931645

### 二、指数基日和基点

该指数以 2013 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 1000 指数样本中满足以下条件的 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 100 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，调出中证 1000 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中证 1000 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。