

中证国新港股通央企红利指数编制方案

中证国新港股通央企红利指数由国新投资有限公司定制，从港股通范围内选取国务院国资委央企名录中分红水平稳定且股息率较高的上市公司证券作为指数样本，以反映港股通范围内股息率较高的央企上市公司证券的整体表现。

一、指数名称和代码

指数名称：中证国新港股通央企红利指数

指数简称：国新港股通央企红利

英文名称：CSI China Reform Hong Kong Connect Central-SOEs High Dividend Yield Index

英文简称：China Reform HKC Central-SOEs High Dividend

指数代码：931722(港元)/931722CNY100(人民币中间价)/931722USD200(美元)

二、指数基日和基点

该指数以 2016 年 12 月 30 日为基日，以 1000 点为基点。

三、样本选取方法

1、样本空间

中证港股通综合指数样本

2、可投资性筛选

对样本空间内证券，计算每月的日换手率中位数作为月换手率，剔除过去 12 个月或过去 3 个月平均月换手率不足 0.1%的证券，除非该证券过去一年日均成

交金额大于 5000 万港元。

3、选样方法

(1) 对于样本空间内符合流动性筛选条件的证券，选取属于国务院国资委央企名录，以及实际控制权或第一大股东归属于国务院国资委的上市公司证券；

(2) 在上述证券中，选取金融、房地产行业过去一年日均总市值排名第一的证券及其他行业的全部证券作为待选证券；

(3) 在上述待选证券中，选取过去三年连续分红且过去三年股利支付率的均值和过去一年股利支付率均大于 0 且小于 1 的上市公司证券作为待选样本；

(4) 在上述待选样本中，按照过去三年平均股息率由高到低排名，选取排名靠前的 50 只证券作为指数样本。

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 = Σ (证券价格 × 调整股本数 × 权重因子 × 汇率)。汇率、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调整后的自由流通市值加权，同时单个样本权重不超过 10%，金融、房地产行业单个样本权重不超过 2%。

五、指数样本和权重调整

1、定期调整

指数样本每年调整一次，样本调整实施时间为每年 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

当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。当港股通证券范围发生变动导致样本不再满足互联互通资格时，指数将相应调整。