

中证智选高股息策略指数编制方案

中证智选高股息策略指数选取 50 只连续分红且现金分红预案股息率较高的上市公司证券作为指数样本，以反映股息率较高上市公司证券的整体表现。

一、指数名称和代码

指数名称：中证智选高股息策略指数

指数简称：智选高股息

英文名称：CSI High Dividend Strategy Custom Index

英文简称：High Dividend Custom

指数代码：932305

二、指数基日和基点

该指数以 2005 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

同中证全指指数的样本空间

2、可投资性筛选

过去一年日均成交金额排名位于样本空间前 90%。

3、选样方法

(1) 选取同时满足以下条件的证券作为待选样本：

- 过去三年连续现金分红；
- 已披露现金分红预案且预案中合计每股税前现金股利大于 0。

(2) 根据上市公司披露的现金分红预案，计算待选样本股息率，并降序排列，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 = \sum (证券价格 × 调整股本数 × 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，以使样本采用现金分红预案股息率/过去一年波动率加权，且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

指数样本每年调整一次，样本调整实施时间为每年 5 月的第六个交易日。

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。