

## 华证港股通高股息 50 指数编制方案

### 一、指数名称和代码

指数名称：华证港股通高股息 50 指数

指数简称：港股通高股息 50

英文名称：SSI HK Connect High Dividend 50 Index

英文简称：HK Connect High Dividend 50

指数代码：995203

### 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

同华证港股通综合指数的样本空间

#### 2. 可投资性筛选

过去 1 年的日均成交金额不少于 2000 万港元。

#### 3. 选样方法

(1) 在符合上述可投资性筛选条件的样本空间内，剔除股息支付金额波动较大和 Alpha 动量排名靠后的公司后，选择近三年平均股息率最高的 80 家公司作为备选样本；若样本调整时间为 3、6、9 月，则沿用上一期备选样本；

(2) 在备选样本中，剔除 Alpha 动量排名后 20 的股票；最后在

剩余样本中，选择近三年平均股息率前 50 的股票作为最终样本。

#### 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 =  $\sum$ （股价 × 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，以使样本按照股息率加权。

#### 五、指数样本和权重调整

##### 1. 定期调整

指数样本每季度调整一次，调整实施时间为每年 3 月、6 月、9 月和 12 月的第 10 个交易日，每次调整的样本比例一般不超过 20%。

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样本进行调整。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、停牌等情形的处理，参照计算与维护细则处理。