

# 中证中美互联网指数编制方案

中证中美互联网指数从香港和美国市场选取十大中国互联网上市公司及十大美国互联网上市公司证券作为指数样本，并使中国和美国互联网公司权重之比为 1:1，以反映中美两国互联网上市公司证券的整体表现。

## 一、指数名称和代码

指数名称：中证中美互联网指数

指数简称：中美互联网

英文名称：CSI China-U.S. Internet Index

英文简称：CN-US Internet

指数代码：930794（人民币）/930795（美元）

## 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

香港市场：同中证香港 300 指数的样本空间且满足以下条件之一的中国内地公司证券：

- 注册地在中国内地；
- 公司营运中心在中国内地；
- 公司主营业务收入 50%以上来自中国内地。

其他市场：

(1) 在 NYSE 或 NASDAQ 上市交易且注册地在美国的美国公司证券；

(2) 以其他证券交易所为主要上市地、上市交易时间超过 3 个月且满足以下条件之一的中国内地公司证券：

- 注册地在中国内地；
- 公司营运中心在中国内地；
- 公司主营业务收入 50%以上来自中国内地。

## 2、可投资性筛选

过去一年日均成交金额不低于 300 万美元。

## 3、选样方法

(1) 对样本空间内剩余证券，选取符合以下条件之一的公司证券作为待选样本：

- 互联网软件：开发与销售互联网软件的公司；
- 家庭娱乐软件：开发主要在家中使用的家庭娱乐软件和教育软件的公司；
- 互联网零售：主要通过互联网提供零售服务的公司；
- 互联网服务：主要通过互联网提供各类服务的公司；
- 移动互联网：开发与销售移动互联网软件或提供移动互联网服务的公司；

(2) 在上述待选样本中，按照过去一年日均总市值由高到低排名，选取排名靠前的 10 家美国互联网公司证券及 10 家中国互联网公司的证券作为指数样本。其中，若同一家公司的国外市场证券和香港市场证券同时入选，则优先纳入香港市场证券。

## 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 =  $\Sigma$ (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，以使中国互联网公司样本和美国互联网公司样本权重各占 50%，同时单个样本公司权重不超过 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。

权重因子每月调整一次，调整实施时间为每月第二个星期五的下一交易日。

### 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。