

## 中证海外中国互联网指数编制方案

中证海外中国互联网指数选取在香港及其他海外交易所上市的中国互联网公司证券组成指数样本，反映境外上市中国互联网公司证券的整体表现。

### 一、指数名称和代码

指数名称：中证海外中国互联网指数

指数简称：中国互联网

英文名称：CSI Overseas China Internet Index

英文简称：China Internet

指数代码：H11136（人民币）/H11137（美元）

### 二、指数基日和基点

该指数以 2007 年 6 月 29 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：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（除

非该证券发行市值超过 30 亿美元) 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

- (1) 流动性要求: 过去一年日均成交金额不低于 300 万美元;
- (2) 市值要求: 过去一年日均总市值不低于 20 亿美元。

## 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) 将上述待选样本作为指数样本。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

指数的计算公式为:

$$\text{报告期指数} = \frac{\text{报告期样本的调整市值}}{\text{除数}} \times 1000$$

其中，调整市值 =  $\sum(\text{证券价格} \times \text{调整股本数} \times \text{权重因子} \times \text{汇率})$ 。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，以使单个样本权重不超过 10%，前五大样本权重合计不超过 40%。

## 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。如果新上市中国互联网公司发行总市值超过 100 亿美元，且上市时间达到 10 个交易日，则在下月的第二个星期五的下一交易日快速纳入指数。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。