

中证海外中国互联网 50 指数编制方案

中证海外中国互联网 50 指数从香港及其他海外交易所选取 50 只中国互联网公司证券作为指数样本，反映境外上市中国互联网企业的整体表现。

一、指数名称和代码

指数名称：中证海外中国互联网 50 指数

指数简称：中国互联网 50

英文名称：CSI Overseas China Internet 50 Index

英文简称：China Internet 50

指数代码：H30533（人民币）/ H30534（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) 对于剩余证券, 按过去一年日均成交金额以及过去一年日均总市值综合排名(1:1), 选取排名靠前的 50 只证券作为指数样本。若剩余证券不足 50 只, 剩余证券全部作为指数样本。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 = $\Sigma(\text{证券价格} \times \text{调整股本数} \times \text{权重因子} \times \text{汇率})$ 。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，以使得单个样本权重不超过30%。

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是每年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。