

中证海外中国互联网 30 指数编制方案

中证海外中国互联网 30 指数从香港及其他海外交易所选取 30 只中国互联网公司证券作为指数样本，以反映境外上市的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 30 指数

指数简称：中国互联网 30

英文名称：CSI Overseas China Internet 30 Index

英文简称：China Internet 30

指数代码：930604（人民币）/ 930605（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 100 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) 在上述待选样本中, 按过去一年日均成交金额以及过去一年日均总市值按 1:1 由高到低计算综合排名, 选取排名靠前的 30 只证券成为指数样本, 待选样本不足 30 只时全部纳入。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 = Σ (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，以使单个样本权重不超过 15%，前五大样本权重合计不超过 60%。

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。