



中華證券交易服務有限公司  

---

CHINA EXCHANGES SERVICES  
COMPANY LIMITED

# 中华交易服务

## 中国海外民企指数编制方案

2018年6月1日



# 目 录

引言 .....	- 2 -
1. 指数名称与代码 .....	- 3 -
2. 指数基日与基点 .....	- 3 -
3. 样本选取方法 .....	- 3 -
4. 指数计算 .....	- 4 -
5. 指数样本权重调整 .....	- 5 -
6. 指数规则的修订和补充 .....	- 6 -
7. 信息披露 .....	- 6 -
联系我们 .....	- 7 -

## 引言

中华交易服务中国海外民企指数由中华证券交易服务有限公司(中华交易服务)委托中证指数有限公司(中证指数)进行编制, 指数编制方案由中华交易服务及中证指数共同确定。

中华交易服务中国海外民企指数(中华民企指数)为股票价格指数, 由香港联合交易所、纽约证券交易所(NYSE)、纽约证券交易所MKT(NYSE MKT)及纳斯达克(Nasdaq)市值最大的30家上市中国民营企业组成, 旨在反映中国海外民营企业的整体状况和走势。

指数简称	发布日	样本股
中华民企指数	23-1-2017	由香港联合交易所、纽约证券交易所、纽约证券交易所MKT及纳斯达克市值最大的30家上市中国民营企业组成。

## 1. 指数名称与代码

指数名称	指数简称	指数货币	指数代码
中华交易服务中国海外民企指数	中华民企指数	美元	CESCPE

## 2. 指数基日与基点

中华民企指数以 2008 年 12 月 31 日为基日，基点为 1000 点。

## 3. 样本选取方法

### 3.1 样本空间

中华民企指数的样本空间由满足以下条件的香港联合交易所、纽约证券交易所、纽约证券交易所 MKT 及纳斯达克上市的中国民营企业普通股组成。

- 公司需符合以下三个条件之一：
  - ◆ 注册地在中国大陆；
  - ◆ 公司营运中心在中国大陆；
  - ◆ 公司主营业务收入 **50%**以上来自中国大陆。
- 公司为中国民营企业，实际控制人为自然人，且政府持股不超过 20%。
- 公司上市交易时间超过三个月。

### 3.2 选样方法

中华民企指数的样本股按照以下方法选择：

- **流动性甄选:** 样本空间股票日均成交金额不少于 50 万美元。  
日均成交金额的定义如下:
  - ◆ 股票近一年每日平均成交金额, 或
  - ◆ 就新上市公司而言, 新股上市第四个交易日至审核截止日以来每日平均成交金额。
- **市值甄选:** 样本空间股票日均总市值不小于 5 亿美元(包括 A 股上市部分之市值)。日均总市值的定义如下:
  - ◆ 股票近一年每日平均总市值, 或
  - ◆ 就新上市公司而言, 新股上市第四个交易日至审核截止日以来每日平均总市值。
- 对样本空间的剩余股票, 按照过去一年日均总市值(包括 A 股上市部分之市值)进行排序, 选取排名靠前的 30 只股票作为指数样本股。

#### 4. 指数计算

中华民企指数采用以下指数公式进行计算:

$$\text{报告期指数} = \frac{\text{报告期股本数的调整市值}}{\text{除数}} \times 1000$$

其中, 调整市值 =  $\sum$  (股价  $\times$  调整股本数  $\times$  权重调整因子  $\times$

汇率)。调整股本数的计算方法参见计算与维护细则。在中华民企指数计算中，权重调整因子介于 0 和 1 之间，以使样本股权重不超过 15%。

## 5. 指数样本权重调整

### 5.1 定期调整

中华民企指数的样本股每半年调整一次，样本股调整实施时间分别是每年 6 月和 12 月的第二个星期五收盘后的下一交易日。样本调整设置缓冲区，过去一年日均总市值排名在前 24 名的新样本优先进入，过去一年日均总市值排名在前 36 名的老样本优先保留。

权重调整因子随样本股定期调整而调整，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，权重调整因子一般固定不变。

在每次样本股定期调整时，设置 5 只备选样本股作为备选名单。

### 5.2 临时调整

在有特殊事件发生，以致影响指数代表性与可投资性时，将对中华民企指数样本将进行临时调整。发生临时调整时，由备选名单中排名最高的股票取代被剔除的股票。详情参见计算与维护细则处理。

## 6. 指数规则的修订和补充

根据市场的发展变化和指数用户的回馈,中华交易服务和中证指数在有需要时将对指数规则进行修订或补充。指数规则的调整须提早对市场公布。

## 7. 信息披露

为保证指数的客观性、中立性和权威性,建立严格的信息披露制度,确保指数的透明、公开和公平。

- 任何信息在公开披露之前,任何人包括工作人员不得私自向外界公开,不得私自接受媒体采访。
- 信息披露的媒体包括但不限于中华证券交易服务有限公司网站及中证指数有限公司网站。
- 样本股的定期审核结果一般提前两周公布;样本股临时调整方案尽可能提前公布;指数编制和维护规则的重大调整一般提前两周公布。

## 联系我们

有关中华交易服务中国海外民企指数和基本规则的详尽数据，欢迎联络中华证券交易服务有限公司的指数服务委托商(中证指数有限公司)。

### 客户服务

#### 中证指数有限公司(指数服务委托商)

中国上海市浦东新区锦康路 308 号陆家嘴世纪金融广场 6 号楼

13 层 (邮编: 200127)

电话: 0086 21 5018 5500

传真: 0086 21 5018 6368

电邮: [csindex@sse.com.cn](mailto:csindex@sse.com.cn)

网站: <http://www.csindex.com.cn/>

### 指数授权

#### 中华证券交易服务有限公司

香港中环康乐广场八号交易广场二期 9 楼 906-908 室

电话: 852 2803 8200

传真: 852 2868 3770

电邮: [cescinfo@cesc.com](mailto:cescinfo@cesc.com)

网站: <http://www.cesc.com/>