

提要

- 該指數的成分股公司為海外民營企業，在擁有權架構上較為自主，而同時得到政府的大力支持，普遍被視為具有動力的企業
- 旨在追蹤於香港或美國上市的30只市值最大中國民營企業股票的表現
- 成份股按自由流通調整比重，以反映市場實際可投資股票表現
- 每半年審核一次，保持指數代表性並同時減低成份股周轉率

指數概覽

推出日期：2017年1月23日
 基日：2008年12月31日
 基值：1,000
 檢討週期：每半年度（6月及12月）
 指數發布：每日一次，於收市後發佈
 成份股數量：30
 指數計算貨幣：美元及港幣
 股息累計指數：美元及港幣

香港資訊供應商編碼

彭博資訊：CESCPE
 湯森路透：.CSICESCPE

中國內地資訊供應商編碼

大智慧：CESCPELITE
 萬得：CESCPE

聯絡我們

電子郵件：cescinfo@cesc.com
 微信公眾號：ChinaExchanges



微博：中華證券交易服務有限公司



www.cesc.com

歷史表現



回報率及波動率

| | 指數價格 | 回報率 (%) | | | | | | | | 年化回報率 (%) | | | 波動率 (%) | | |
|--------|----------|---------|-------|-------|-------|-------|-------|--------|--------|-----------|-------|-------|---------|-------|-------|
| | | 1個月 | 3個月 | 6個月 | 年初至今 | 1年 | 3年 | 5年 | 自基日起計 | 1年 | 3年 | 5年 | 1年 | 3年 | 5年 |
| 中華民企 | 6,334.74 | -2.83 | -2.86 | -3.55 | -3.55 | 26.31 | 65.97 | 152.00 | 533.47 | 26.31 | 18.40 | 20.30 | 19.81 | 20.61 | 19.06 |
| 股息累計指數 | 7,021.17 | -2.51 | -2.37 | -3.04 | -3.04 | 27.45 | 70.32 | 165.14 | 602.12 | 27.45 | 19.42 | 21.53 | 19.80 | 20.60 | 19.06 |

波動率基於每日收益

一年相關性

| | 中華120 | 中華280 | 中華港股通精選100 | 中華香港內地 | 中華A80 |
|------|-------|-------|------------|--------|-------|
| 中華民企 | 0.70 | 0.61 | 0.75 | 0.76 | 0.51 |

指數基本分析

| | | | |
|----------------|--------|-------------|-------|
| 周息率 (%) | 0.63 | 最大成份股權重 (%) | 15.27 |
| 市價/盈利率 (倍) | 28.23 | 市值涵蓋率 (%)* | 68.17 |
| 指數流通市值 (十億美元) | 532.18 | 成交額涵蓋率 (%)* | 71.44 |
| 最大成份股市值 (十億美元) | 81.27 | | |
| 最小成份股市值 (十億美元) | 1.15 | | |
| 平均成份股市值 (十億美元) | 17.74 | | |

* 指數樣本空間包含於香港交易所、紐約證券交易所、納斯達克或紐約證券交易所MKT第一上市的中國民營企業

中華交易服務中國海外民企指數（中華民企指數）

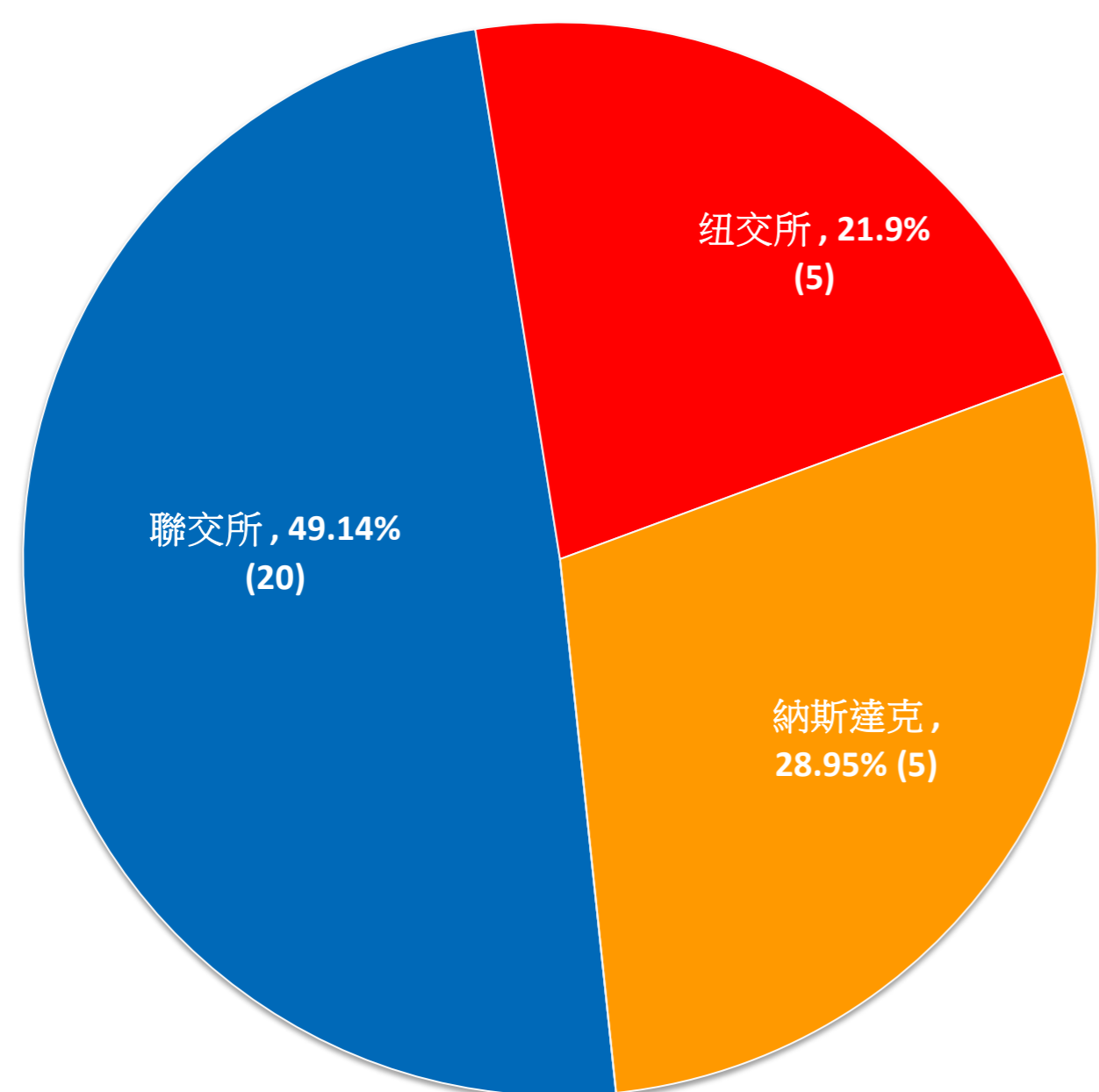
最大權重的20家公司

| 排名 | 股票代號 | 成份股名稱 | 行業 | 上市交易所 | 自由流通市值 (十億美元) | 權重(%) |
|----|-------|--------|------|-------|------------------|-------|
| 1 | 00700 | 騰訊控股 | 信息技術 | 聯交所 | 81.27 | 15.27 |
| 2 | BABA | 阿里巴巴 | 信息技術 | 紐交所 | 76.05 | 14.29 |
| 3 | BIDU | 百度 | 信息技術 | 納斯達克 | 67.24 | 12.64 |
| 4 | 02318 | 中國平安 | 金融地產 | 聯交所 | 47.97 | 9.01 |
| 5 | NTES | 網易 | 信息技術 | 納斯達克 | 33.18 | 6.24 |
| 6 | JD | 京東商城 | 可選消費 | 納斯達克 | 28.95 | 5.44 |
| 7 | CTRP | 攜程網 | 可選消費 | 納斯達克 | 21.50 | 4.04 |
| 8 | 02007 | 碧桂園 | 金融地產 | 聯交所 | 15.30 | 2.87 |
| 9 | YUMC | 百勝中國 | 可選消費 | 紐交所 | 15.00 | 2.82 |
| 10 | 02382 | 舜宇光學科技 | 可選消費 | 聯交所 | 14.29 | 2.69 |
| 11 | 00175 | 吉利汽車 | 可選消費 | 聯交所 | 13.97 | 2.63 |
| 12 | EDU | 新東方教育 | 可選消費 | 紐交所 | 11.99 | 2.25 |
| 13 | 02018 | 瑞聲科技 | 信息技術 | 聯交所 | 10.33 | 1.94 |
| 14 | 03333 | 中國恒大 | 金融地產 | 聯交所 | 9.98 | 1.88 |
| 15 | 02313 | 申洲國際 | 可選消費 | 聯交所 | 9.28 | 1.74 |
| 16 | 01918 | 融創中國 | 金融地產 | 聯交所 | 9.24 | 1.74 |
| 17 | ZTO | 中通快遞 | 工業 | 紐交所 | 8.78 | 1.65 |
| 18 | 00384 | 中國燃氣 | 公用事業 | 聯交所 | 7.99 | 1.50 |
| 19 | 01044 | 恒安國際 | 主要消費 | 聯交所 | 7.11 | 1.34 |
| 20 | 01988 | 民生銀行 | 金融地產 | 聯交所 | 5.95 | 1.12 |
| 合計 | | | | | 495.37 | 93.08 |

聯交所：香港聯合交易所
紐交所：紐約證券交易所
納斯達克：納斯達克
紐交所MKT：紐約證券交易所MKT

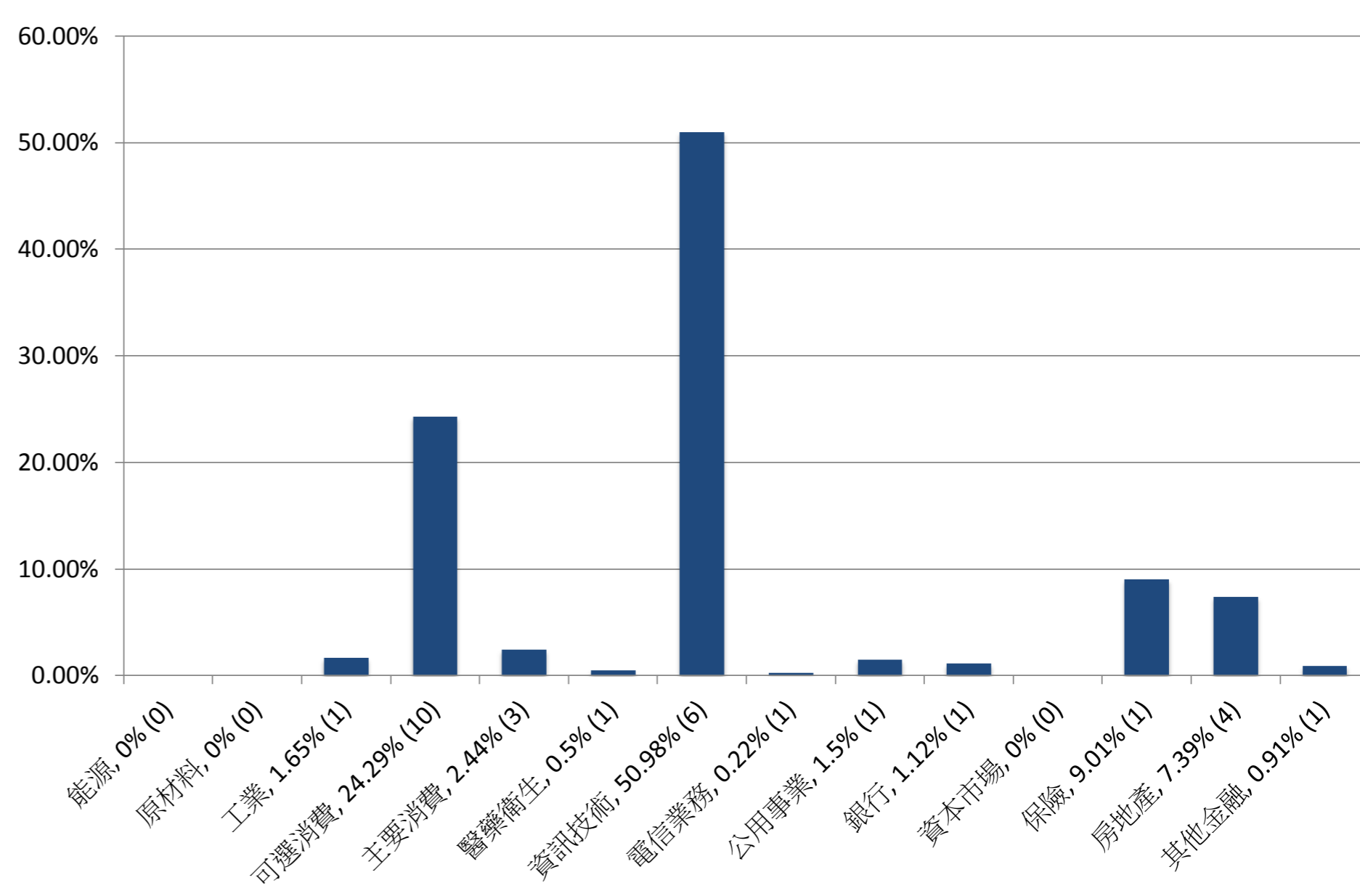
以市值計上市交易所比重

(括號內數字為成份股數目)



以市值計行業比重

(括號內數字為成份股數目)



備註：銀行、資本市場、保險、房地產及其他金融統稱為金融地產

由於以四捨五入的方法計算，比重之總和不一定等於總值

數據來源：中華交易服務，中證指數，截至2018年6月30日

免責聲明

所有此處所載的資訊（資訊）僅供參考。中華證券交易服務有限公司（中華交易服務）竭力確保資訊的準確性和可靠性，但對其準確性、完整性、可靠性或對任何特定用途的適用性不作任何保證或陳述。對於任何因資訊不準確或遺漏或因根據資訊所作的決定、行動或不採取行動所引致的損失或損害中華交易服務概不負責（不論是民事侵權行為責任或合約責任或其他）資訊並不意圖構成投資意見或建議作出（或不作出）任何投資決定。任何人士有意使用資訊或其任何部分應尋求獨立專業意見。在未經中華交易服務事先書面許可，嚴禁以任何形式或任何方法分發，再分發、複製、修改、傳播、使用、再使用及/或存儲資訊的全部或部分。

中證指數有限公司（中證指數）並未就資訊的提供做出過任何明示或暗示的保證，包括對其適銷性、適銷品質、所有權、特定目的的適用性、安全性及非侵權等的保證。中證指數將盡合理的商業努力確保該等資訊的準確性和可靠性，但並不對此予以擔保。任何人因該等資訊不準確、缺失或因依賴其任何內容而造成的任何損失和損害，中證指數概不承擔責任（無論其為侵權、違約或其他責任）

© 2018年中華證券交易服務有限公司。版權所有