

## 中证国泰君安国际中国影视文化主题指数编制方案

中证国泰君安国际中国影视文化主题指数选取在上海证券交易所、深圳证券交易所和香港交易所上市的中国影视文化产业相关公司作为样本股，采用自由流通市值加权计算，以反映沪深港三地市场中国影视文化相关公司的整体状况和走势。

### 一、 指数名称和代码

指数名称：中证国泰君安国际中国影视文化主题指数

指数简称：GTJA Intl 中国影视

英文名称：CSI GTJA International China Film & Television Culture Thematic Index

英文简称：GTJA Intl China Film & TV

指数代码：930912（人民币）/930913（港元）

### 二、 指数基日和基点

该指数以 2011 年 12 月 30 日为基日，以 1000 点为基点。

### 三、 样本选取方法

#### 1、 样本空间

中证国泰君安国际中国影视文化主题指数样本空间由沪深 A 股以及香港上市的中国内地股票组成。

其中沪深 A 股需要满足以下条件：

- 1) 上市时间超过一个季度，除非该股票自上市以来的日均 A 股总市值在全部沪深 A 股中排在前 30 位；
- 2) 非 ST、\*ST 股票，非暂停上市股票。

对于在香港上市交易的中国公司来说，需符合下列三个条件之一、且上市交易时间超过 3 个月：

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。

并且香港市场上市的股票应同时满足以下条件：

- (1) 在香港交易所主板和创业板上市且以香港为主要上市地的普通股；
- (2) 上市交易时间超过 3 个月，除非该证券上市以来日均香港总市值在全部香港市场证券中排在前 10 位；
- (3) 剔除最近过去一年日均股价小于 0.1 港元的证券；
- (4) 剔除最近过去一年日均股价小于 0.5 港元而且最近年度报告每股收益 (EPS) 小于 0 的证券；
- (5) 剔除最近三个月日均换手率不满足条件的证券。

## 2、选样方法

(1) 对于样本空间内的证券，剔除过去一年日均成交金额小于 100 万港元的证券。

(2) 对剩余的证券，选取符合以下定义的证券作为影视文化主题证券：

传媒行业：包括广播与有线电视、电影与娱乐、出版。

互联网影视娱乐：主要通过互联网提供影视娱乐服务的公司。

动漫文化：动漫文化相关的公司。

(3) 对于剩余证券，按过去一年日均总市值综合排名，选取排名靠前的 50 家证券成为指数样本。若剩余证券不足 50 只，剩余证券全部作为指数样本股。

## 四、 指数计算

中证国泰君安国际中国影视文化主题指数计算公式为：

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

其中，调整市值=Σ（股价×调整股本数×权重因子×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；汇率采用汤森路透综合汇率报价中间价。权重因子介于0和1之间，以使样本股权重不超过10%。

## 五、 指数样本和权重调整

### 1、 定期调整

中证国泰君安国际中国影视文化主题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月的第二个星期五后的下一交易日。

权重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。

### 2、 临时调整

特殊情况下将对中证国泰君安国际中国影视文化主题指数样本进行临时调整。当样本股暂停上市或退市时，将其从指数样本中剔除。样本股公司发生收购、合并、分拆、停牌等情形的处理，参照计算与维护细则处理。