

中证美国上市中国内地企业指数编制方案

中证美国上市中国内地企业指数从美国上市中国内地企业中挑选市值最大的 25 只股票组成样本股，以反映美国上市中国内地企业股票的整体表现，并为市场提供新的投资工具。

一、指数名称和代码

中文全称：中证美国上市中国内地企业指数

中文简称：美股中国内地

英文全称：CSI US-Listed China Mainland Enterprises Index

英文简称：US-Listed China

指数代码：930646（USD）/930647（CNY）

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

在美国主要上市交易且上市时间超过 3 个月（除非新上市股票的发行总市值在全球中国内地公司中排名前十）的中国内地企业股票。这里中国内地企业是指符合下列三个条件之一的公司：

- （1）注册地在中国内地；
- （2）公司营运中心在中国内地；
- （3）公司主营业务收入 50% 来自中国内地。

2、选样方法

(1) 剔除样本空间内过去一年日均成交金额排名在后 50% 的股票。

(2) 对剩余股票按照最近一年日均总市值从高到低排名，选取排名在前 25 的股票作为指数样本。

四、 指数计算

中证美国上市中国内地企业指数计算公式为：

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

其中，调整市值 = Σ (股价 × 调整股本数 × 权重因子 × 汇率)。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

中证美国上市中国内地企业指数的样本股每半年调整一次，样本调整实施时间为每年 6 月和 12 月的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样本进行临时调整。如果新上市股票的发行总市值在全球中国内地公司中排名前十，则在其上市第十一个交易日快速纳入指数。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。