

中证移动互联网指数编制方案

中证移动互联网指数从沪深市场选取移动终端提供商、移动互联网平台运营商、通过移动互联网平台商品销售商和内容服务提供商，以及其他受益于移动互联网的上市公司证券作为指数样本，以反映移动互联网主题上市公司证券的整体表现。

一、指数名称和代码

指数名称：中证移动互联网指数

指数简称：移动互联

英文名称：CSI Mobile Internet Index

英文简称：Mobile Internet

指数代码：399970

二、指数基日和基点

该指数以 2012 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

同中证全指指数的样本空间

2、选样方法

(1) 对样本空间内证券按照过去一年的日均成交金额由高到低排名，剔除排名后 20% 的证券；

(2) 对样本空间内剩余证券，将移动终端提供商、移动互联网平台运营商、

通过移动互联网平台商品销售商和内容服务提供商,以及其他受益于移动互联网的上市公司证券纳入移动互联网主题;

(3) 在上述待选样本中,按照过去一年日均总市值由高到低排名,选取不超过100只证券作为指数样本。

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 = $\sum(\text{证券价格} \times \text{调整股本数} \times \text{权重因子})$ 。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3%。

五、指数样本和权重调整

1、定期调整

指数样本每季度调整一次,样本调整实施时间分别为每年3月、6月、9月和12月的第二个星期五的下一交易日。

权重因子随样本定期调整而调整,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,权重因子一般固定不变。

2、临时调整

特殊情况下将对指数进行临时调整。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。