

中证互联网金融指数编制方案

中证互联网金融指数选取与支付、融资、投资、保险、金融信息服务以及其他与互联网金融相关的代表性上市公司证券作为指数样本，以反映互联网金融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：中证互联网金融指数

指数简称：互联金融

英文名称：CSI Internet Finance Index

英文简称：CSI Internet Finance

指数代码：399805

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，将与支付、融资、投资、保险、金融信息服

务以及其他与互联网金融相关的上市公司证券纳入互联网金融主题，包括但不限于第三方支付、P2P、众筹、小贷、互联网基金、互联网券商、互联网银行、互联网保险、征信、金融信息服务，其他与互联网金融相关的上市公司证券作为待选样本；

(3) 在待选样本中，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，以使金融地产行业权重不超过30%，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

指数样本每半年调整一次，样本调整实施时间分别为每年6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。