

## 中证全球中国教育主题指数编制方案

中证全球中国教育主题指数从全球上市的中国内地公司证券中选取 50 只流动性较好、市值较大的教育相关上市公司证券作为指数样本，以反映全球范围内中国教育公司证券的整体表现。

### 一、指数名称和代码

指数名称：中证全球中国教育主题指数

指数简称：中国教育

英文名称：CSI Global China Education Thematic Index

英文简称：China Education

指数代码：931456（人民币）/ 931457（港元）/ 931458（美元）

### 二、指数基日和基点

该指数以 2014 年 12 月 31 日为基日，以 1000 点为基点。

### 三、样本选取方法

#### 1、样本空间

沪深市场：同中证全指指数的样本空间

香港市场：同中证香港 300 指数的样本空间且满足以下条件之一的中国内地公司证券：

- 注册地在中国内地；
- 公司营运中心在中国内地；
- 公司主营业务收入 50% 以上来自中国内地。

美国市场：中证中国内地企业综合指数样本中在美国上市的证券

## 2、可投资性筛选

(1) 流动性要求：对沪深市场证券，过去一年日均成交金额排名位于样本空间内沪深市场证券的前 80%；对香港市场证券，过去一年日均成交金额不低于 500 万港元；对美国市场证券，过去一年日均成交金额不低于 100 万美元；

(2) 市值要求：过去一年日均总市值不低于 30 亿人民币。

## 3、选样方法

(1) 对样本空间内剩余证券，选取属于教育服务、信息技术服务、软件开发、电脑与外围设备、电子设备等行业且主营业务涉及教育、教育服务或教育信息化的证券作为待选样本；

(2) 对上述待选样本，按照过去一年日均总市值由高到低排名，优先选取排名前 50 的教育服务行业证券作为指数样本；若教育服务行业内符合条件的证券数量不足 50 只，则从其他行业证券中按照过去一年日均总市值由高到低补足 50 只，不足 50 只时，全部纳入。其中，若同一家公司的国外市场证券和香港市场证券同时入选，则优先纳入香港市场证券。

## 四、指数计算

指数计算公式为：

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

其中，调整市值 =  $\sum(\text{证券价格} \times \text{调整股本数} \times \text{权重因子} \times \text{汇率})$ 。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，以使教育服务行业单个样本权重不超过 15%，其他行业单个样本权重不超过 5%。

## 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。

权重因子每月调整一次，调整实施时间为每月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。