

中证沪港深中国教育主题指数编制方案

中证沪港深中国教育主题指数从沪深 A 股及港股通范围内的中国内地企业股票中选取 50 只流动性较好、市值较大的教育主题相关股票作为样本股，以反映沪港深三地中国教育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：中证沪港深中国教育主题指数

指数简称：SHS 中国教育

英文名称：CSI SH-HK-SZ China Education Thematic Index

英文简称：SHS China Education

指数代码：930717（人民币）/931462（港元）

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

中证全指和中证港股通中国内地企业综合指数样本股

2、选样方法

（1）对于样本空间内的沪深 A 股，按照过去一年日均成交金额由高到低排序，剔除排名靠后 20% 的股票；对于样本空间内的港股，剔除过去一年日均成交金额不足 500 万港元的证券；

（2）剔除样本空间内过去一年日均总市值不足 30 亿人民币的股票；

（3）对剩余股票，选取中证行业分类下属于教育服务、信息技术服务、软

件开发、电脑与外围设备及电子设备等行业且公司主营业务涉及教育、教育服务或教育信息化的股票作为教育主题空间；

(4) 对教育主题空间股票，优先按照过去一年日均总市值由高到低选取 50 只属于教育服务行业的股票作为指数样本股；若教育服务行业内符合条件的股票数量不足 50 只，则从其他行业股票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。

四、指数计算

中证沪港深中国教育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 = $\sum(\text{股价} \times \text{调整股本数} \times \text{权重因子} \times \text{汇率})$ 。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一样本权重不超过 10%，其他行业单一样本权重不超过 5%。

五、指数样本和权重调整

1、定期调整

中证沪港深中国教育主题指数每半年调整一次样本股，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。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、分拆等情形的处理，参照计算与维护细则处理。当港股通范围发生变动导致样本股不再满足互联互通资格时，将进行相应调整。