

中证中国铁路债券指数系列编制方案

中证中国铁路债券指数系列从沪深交易所或银行间市场上市的债券中,选取中国国家铁路集团有限公司发行的债券组成样本券,指数采用市值加权计算。

一、指数名称和代码

指数名称	指数简称	英文名称	英文简称	指数代码
中证中国铁路债券指数	铁路债券	CSI China Railway Bond Index	Railway Bond	931360
中证中国铁路0-1年债券指数	铁路债券0-1	CSI China Railway 0-1Y Bond Index	Railway Bond 0-1Y	931361
中证中国铁路1-3年债券指数	铁路债券1-3	CSI China Railway 1-3Y Bond Index	Railway Bond 1-3Y	931362
中证中国铁路1-5年债券指数	铁路债券1-5	CSI China Railway 1-5Y Bond Index	Railway Bond 1-5Y	931363
中证中国铁路3-5年债券指数	铁路债券3-5	CSI China Railway 3-5Y Bond Index	Railway Bond 3-5Y	931365
中证中国铁路5-7年债券指数	铁路债券5-7	CSI China Railway 5-7Y Bond Index	Railway Bond 5-7Y	931366
中证中国铁路5-10年债券指数	铁路债券5-10	CSI China Railway 5-10Y Bond Index	Railway Bond 5-10Y	931367
中证中国铁路7-10年债券指数	铁路债券7-10	CSI China Railway 7-10Y Bond Index	Railway Bond 7-10Y	931368
中证中国铁路10+年债券指数	铁路债券10+	CSI China Railway 10Y+ Bond Index	Railway Bond 10Y+	931369

二、指数基日和基点

该指数系列以2011年12月31日为基日,以100点为基点。

三、样本选取方法

1、样本空间

中证中国铁路债券指数系列的样本空间由满足以下条件的债券构成:

(1) 债券种类：在沪深交易所或银行间市场上市的企业债、公司债、中期票据、短期融资券等，债券币种为人民币；

(2) 发行人：中国国家铁路集团有限公司；

(3) 付息方式：固定利率付息或一次还本付息。

2、选样方法

选取样本空间中剩余期限符合如下条件的债券作为各指数的样本券：

指数代码	指数简称	剩余期限
931360	铁路债券	1 年以上
931361	铁路债券 0-1	1 年及以下
931362	铁路债券 1-3	6 个月以上，3 年及以下
931363	铁路债券 1-5	6 个月以上，5 年及以下
931365	铁路债券 3-5	2.5 年以上，5 年及以下
931366	铁路债券 5-7	4.5 年以上，7 年及以下
931367	铁路债券 5-10	4.5 年以上，10 年及以下
931368	铁路债券 7-10	6.5 年以上，10 年及以下
931369	铁路债券 10+	9.5 年以上

四、指数计算

中证中国铁路债券指数系列采用派许加权综合价格指数方法计算，计算公式为：

$$\text{报告期指数} = \frac{\text{报告期样本债券总市值} + \text{报告期债券派息}}{\text{除数}} \times 100$$

其中，报告期样本债券总市值 = \sum (全价 × 发行量)，全价 = 净价 + 应计利息。

该指数计算用价格为中证估值价格，其他计算用基础数据、除数调整参见计算与维护细则。

五、样本调整

1、定期调整

中证中国铁路债券指数系列样本每月调整一次，定期调整生效日为每月首个交易日，定期调整数据提取日为生效日前一个交易日。

2、临时调整

满足条件的新发债券自上市次日起进入指数。若样本券发生暂停上市、摘牌等事件，视情况自事件生效之日起剔除出指数；样本券发生其他事件，参照计算与维护细则处理。