

中证交易所中国铁路债券指数编制方案

中证交易所中国铁路债券指数从沪深交易所上市的企业债、公司债等债券中，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：中证交易所中国铁路债券指数

指数简称：交易所铁路债券

英文名称：CSI Exchange China Railway Bond Index

英文简称：Exchange Railway Bond

指数代码：931370

二、指数基日和基点

该指数以 2011 年 12 月 31 日为基日，以 100 点为基点。

三、样本选取方法

中证交易所中国铁路债券指数的样本由满足以下条件的债券构成：

(1) 债券种类：在沪深交易所上市的企业债、公司债等，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。

四、指数计算

中证交易所中国铁路债券指数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 \times 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

中证交易所中国铁路债券指数样本每月调整一次，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。