

中证国债及政策性金融债指数系列编制方案

中证国债及政策性金融债指数系列包含 11 条指数。指数采用市值加权计算，反映相应期限国债及政策性金融债的市场表现。

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
中证国债及政策性金融债指数	国债及政金债	CSI Treasury and Policy Bank Bond Index	Treasury and Policy Bank Bond	931303
中证国债及政策性金融债 0-1 年指数	国债及政金债 0-1	CSI Treasury and Policy Bank Bond 0-1Y Index	Treasury and Policy Bank Bond 0-1Y	931304
中证国债及政策性金融债 1-3 年指数	国债及政金债 1-3	CSI Treasury and Policy Bank Bond 1-3Y Index	Treasury and Policy Bank Bond 1-3Y	931305
中证国债及政策性金融债 1-5 年指数	国债及政金债 1-5	CSI Treasury and Policy Bank Bond 1-5Y Index	Treasury and Policy Bank Bond 1-5Y	931306
中证国债及政策性金融债 3-5 年指数	国债及政金债 3-5	CSI Treasury and Policy Bank Bond 3-5Y Index	Treasury and Policy Bank Bond 3-5Y	931307
中证国债及政策性金融债 5-7 年指数	国债及政金债 5-7	CSI Treasury and Policy Bank Bond 5-7Y Index	Treasury and Policy Bank Bond 5-7Y	931308
中证国债及政策性金融债 5-10 年指数	国债及政金债 5-10	CSI Treasury and Policy Bank Bond 5-10Y Index	Treasury and Policy Bank Bond 5-10Y	931309
中证国债及政策性金融债 7-10 年指数	国债及政金债 7-10	CSI Treasury and Policy Bank Bond 7-10Y Index	Treasury and Policy Bank Bond 7-10Y	931310
中证国债及政策性金融债 10+ 年指数	国债及政金债 10+	CSI Treasury and Policy Bank Bond 10Y+ Index	Treasury and Policy Bank Bond 10Y+	931311

中证国债及政策性金融债 10-25 年指数	国债及政金债 10-25	CSI Treasury and Policy Bank Bond 10-25Y Index	Treasury and Policy Bank Bond 10-25Y	931312
中证国债及政策性金融债 30 年指数	国债及政金债 30	CSI Treasury and Policy Bank Bond 30Y Index	Treasury and Policy Bank Bond 30Y	931313

二、指数基日和基点

该指数系列以 2007 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

中证国债及政策性金融债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国债和政策性金融债，债券币种为人民币；

(2) 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细分指数的样本券：

指数代码	指数简称	剩余期限
931303	国债及政金债	1 年以上
931304	国债及政金债 0-1	1 年及以下
931305	国债及政金债 1-3	6 个月以上，3 年及以下
931306	国债及政金债 1-5	6 个月以上，5 年及以下
931307	国债及政金债 3-5	2.5 年以上，5 年及以下
931308	国债及政金债 5-7	4.5 年以上，7 年及以下
931309	国债及政金债 5-10	4.5 年以上，10 年及以下
931310	国债及政金债 7-10	6.5 年以上，10 年及以下
931311	国债及政金债 10+	9.5 年以上
931312	国债及政金债 10-25	9.5 年以上，25 年及以下
931313	国债及政金债 30	25 年以上，30 年及以下

四、指数计算

中证国债及政策性金融债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 \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

中证国债及政策性金融债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。