

中证全债指数编制方案

中证全债指数选取在沪深交易所或银行间市场上市的 **BBB** 及以上、且剩余期限 1 年及以上的国债、金融债、企业债等债券作为成份券，反映全市场相应期限债券的整体表现。

一、指数名称和代码

指数名称：中证全债指数

指数简称：中证全债

英文名称：CSI Aggregate Bond Index

英文简称：CSI Aggregate Bond

指数代码：H11001

二、指数基日和基点

该指数以 2002 年 12 月 31 日为基日，以 100 点为基点。

三、样本选取方法

中证全债指数的样本由满足以下条件的债券构成：

(1) 债券种类：在沪深交易所或银行间市场上市的国债、地方政府债、金融债、企业债、公司债、中期票据等，债券币种为人民币；

(2) 信用评级：**BBB** 及以上；

(3) 债券剩余期限：1 年及以上；

(4) 付息方式：固定利率付息或一次还本付息。

四、指数计算

中证全债指数采用派许加权综合价格指数方法计算，计算公式为：

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

其中, 报告期样本债券总市值 = $\Sigma(\text{全价} \times \text{发行量})$, 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

中证全债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

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。