

中证国债指数编制方案

该指数样本券由剩余年限 1 年及以上且在沪深交易所或银行间市场上市的国债构成。指数采用市值加权计算，以反映全市场相应期限国债的表现。

一、指数名称和代码

指数名称：中证国债指数

指数简称：中证国债

英文名称：CSI Treasury Bond Index

英文简称：CSI Treasury Bond

指数代码：H11006

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

中证国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，债券币种为人民币；

(2) 债券剩余期限：1 年及以上；

(3) 付息方式：固定利率付息和一次还本付息。

四、指数计算

中证国债指数采用指数样本发行量派许加权综合价格指数方法计算，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

中证国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, 自下一定期调样生效日起剔除出指数; 样本券发生其他事件, 参照计算与维护细则处理。