

## 中证金融债指数编制方案

该指数样本券由剩余期限不低于 1 年且在银行间市场上上市的各种金融债构成，样本券信用级别应在投资级以上。指数采用市值加权计算，以反映银行间市场相应期限投资级金融债券的表现。

### 一、指数名称和代码

指数名称：中证金融债指数

指数简称：中证金融债

英文名称：CSI Financial Bond Index

英文简称：CSI Financial Bond

指数代码：H11007

### 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

中证金融债指数的样本由满足以下条件的债券构成：

(1) 债券种类：在银行间市场上上市的金融债，不包括次级债和私募品种，债券币种为人民币；

(2) 信用评级：投资级以上；

(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

中证金融债指数采用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

中证金融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。