

## 中证金边中期国债指数编制方案

该指数是国内首只成份类国债指数，样本由剩余期限4年以上，7年以下且在沪深交易所和银行间市场上市交易的国债组成。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：中证金边中期国债指数

指数简称：中期国债

英文名称：CSI Gilt-edged Medium Term Treasury Bond Index

英文简称：Medium Term Treasury Bond

指数代码：H11017

### 二、指数基日和基点

该指数以2007年12月31日为基日，以100点为基点。

### 三、样本选取方法

中证金边中期国债指数的样本由满足以下条件的债券构成：

(1) 债券种类：在沪深交易所和银行间市场上市的国债，债券币种为人民币；

(3) 债券剩余期限：4年以上，7年以下；

(4) 付息方式：固定利率付息或一次还本付息。

### 四、指数计算

中证金边中期国债指数采用派许加权综合价格指数方法计算，计算公式为：

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

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

中证金边中期国债指数样本每季度定期调整一次, 定期调整生效日为每年 1 月、4 月、7 月和 10 月份的首个交易日, 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, 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。