

中证企业债 100 指数编制方案

该指数是国内首只跨市场成份类信用债券指数，样本由在银行间市场或沪深交易所市场上市的剩余期限 1 年以上，10 年及以下的 100 只信用债组成，样本流动性强、规模大。指数采用市值加权计算。

一、指数名称和代码

指数名称：中证企业债 100 指数

指数简称：中证企债 100

英文名称：CSI Enterprise Bond 100 Index

英文简称：CSI Enterprise Bond 100

指数代码：H11019

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

1、样本空间

中证企业债 100 指数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债券市场上上市的企业债、公司债、中期票据等信用债品种，但不包括短期融资券以及资产支持证券，债券币种为人民币；

(2) 主体评级：AA-及以上；

(3) 债券剩余期限：1 年及以上，10 年及以下；

(4) 付息方式：固定利率付息或一次还本付息。

2、选样方法

(1) 在样本空间中，将上市时间超过 3 年的债券从样本空间中剔除；

(2) 计算企业债在考察区间内日成交金额的中位数，然后按降序排列，将位于中位数后 50% 的债券剔除；

(3) 对剩余债券分别按成交金额、交易天数、发行规模综合排名，选取排名前 100 位的债券作为指数样本。按照步骤 2 剔除中位数后 50% 的债券后，若债券超过 100 只，按 100 只确定，不足 100 只时，按照实际剩余的债券数量确定。

四、指数计算

中证企业债 100 指数采用派许加权综合价格指数方法计算，计算公式为：

$$\text{报告期指数} = \frac{\text{报告期样本债券总市值} + \text{报告期债券派息及再投资} \times 0.8}{\text{除数}} \times 100$$

其中，报告期样本债券总市值 = \sum (全价 \times 发行量 \times 权重因子)。权重因子介于 0 和 1 之间，以使样本券权重不超过 10%，全价 = 净价 + 应计利息 $\times 0.8$ 。

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

中证企业债 100 指数样本每季度调整一次，定期调整生效日分别为每年 1 月、4 月、7 月和 10 月份的首个交易日，定期调整数据考察区间为过去三个月。

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。