

中证 1-10 年国债指数编制方案

中证 1-10 年国债指数样本券由银行间市场上市的剩余期限 1 年以上，10 年以下且流动性强、规模大的国债组成。指数采用市值加权计算，以反映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 1-10 年国债指数

指数简称：中证 1-10 国债

英文名称：CSI 1-10 Year Treasury Bond Index

英文简称：CSI 1-10 Year Treasury Bond

指数代码：H11071

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 1-10 年国债指数的样本由满足以下条件的债券构成：

- (1) 债券种类：在银行间市场上市的国债，债券币种为人民币；
- (2) 债券余额：50 亿以上；
- (3) 债券剩余期限：1 年以上,10 年以下；
- (4) 付息方式：固定利率付息或一次还本付息；
- (5) 上市期限：3 年以下。

四、指数计算

中证 1-10 年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 1-10 年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。

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。