

## 中证中票 50 指数编制方案

中证中票 50 指数是中证指数公司发布的首只中期票据类成份债券指数，该指数从银行间市场挑选 50 只流动性强、规模大的中期票据组成样本。指数采用市值加权计算。

### 一、指数名称和代码

指数名称：中证中票 50 指数

指数简称：中证中票 50

英文名称：CSI Medium Term Note 50 Index

英文简称：CSI Medium Term Note 50

指数代码：H11072

### 二、指数基日和基点

该指数以 2008 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

中证中票 50 指数的样本由满足以下条件的债券构成：

- (1) 债券种类：在银行间债券市场上上市的中期票据，债券币种为人民币；
- (2) 发行主体评级：AA 级及以上；
- (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。

## 2、选样方法

(1) 计算样本空间中不同主体信用级别中期票据的数量占比，据此确定 50 只成份券中不同主体信用级别中期票据的数量；

(2) 将上市时间超过 3 年的债券从样本空间中剔除；

(3) 计算中期票据在考察区间内日成交金额的中位数，按照中位数剩余债券进行降序排序，并将排名后 50% 的债券剔除；

(4) 分别对不同主体信用级别的剩余债券按成交金额、交易天数、债券余额进行综合排名，按前述不同主体信用级别中期票据的数量选取排名靠前的相应数量债券作为指数样本。

## 四、指数计算

中证中票 50 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)，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

中证中票 50 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。