

## 中证长期国债指数编制方案

中证长期国债指数选取沪深交易所或银行间市场上市时间短、剩余期限 6.5 年以上 10 年及以下的国债作为样本券，以反映全市场相应期限国债的市场表现。

### 一、指数名称和代码

指数名称：中证长期国债指数

指数简称：长期国债

英文名称：CSI Long Term Treasury Bond Index

英文简称：Long Term Treasury Bond

指数代码：H11075

### 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

中证长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：在沪深交易所或银行间市场上市的国债，债券币种为人民币；

(2) 债券剩余期限：6.5 年以上，10 年及以下；

(3) 付息方式：固定利率付息或一次还本付息；

(4) 上市期限：3 年以下。

### 四、指数计算

中证长期国债指数的计算公式为：

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

其中，报告期样本债券总市值=Σ（全价×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

中证长期国债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。

### 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。