

中证中期综合债指数编制方案

该指数样本由在沪深交易所市场和银行间市场上市的质地好、流动性强、规模大的利率债和信用债组成。指数采用市值加权计算。

一、指数名称和代码

指数名称：中证中期综合债指数

指数简称：中期综合

英文名称：CSI Medium Term Universal Bond Index

英文简称：Medium Term Universal Bond

指数代码：H11076

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

中证中期综合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公开发行的国债、金融债、公司债和企业债等，债券币种为人民币；

(2) 信用评级：AA 及以上；

(3) 债券剩余期限：3 年及以上，7 年及以下；

(4) 付息方式：固定利率付息或一次还本付息；

(5) 上市期限：3 年及以下。

2、选样方法

(1) 各成份券数量。银行间利率债券数量占指数样本 40%左右，银行间信用债券数量占比为 40%左右，交易所信用债券的数量占比 20%左右，总数量为 100 只；

(2) 在样本空间中，剔除上市时间超过 3 年的债券；

(3) 计算各信用类型债券在考察区内日成交额的中位数，按照中位数对剩余债券降序排序，将排名后 50%的样本剔除；

(4) 分别对剩余债券按成交金额、交易天数、债券余额进行综合排名，分别按各信用类型的数量，选取综合排名靠前的债券作为指数样本。

四、指数计算

中证中期综合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=Σ（全价×发行量×权重因子），权重因子为发行量的调节因子，利率债券为 0.25，信用债券为 1。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

中证中期综合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，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。