

中证中高等级信用债指数编制方案

该指数样本券交易所或银行间市场上市的、剩余期限高于1年、且信用评级不低于AA+级的信用债券构成。指数采用市值加权计算，以反映全市场相应期限AA+及以上信用债券的表现。

一、指数名称和代码

指数名称：中证中高等级信用债指数

指数简称：中高信用

英文名称：CSI Medium-High Grade Credit Bond Index

英文简称：Medium-High Grade Credit Bond

指数代码：H11078

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

中证中高等级信用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市交易的企业债、公司债和中期票据等信用债品种，债券币种为人民币；

(2) 信用评级：AA+及以上；

(3) 债券剩余期限：1年以上；

(4) 付息方式：固定利率付息或一次还本付息。

四、指数计算

中证中高等级信用债指数采用派许加权综合价格指数方法计算，计算公式为：

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

其中，报告期样本债券总市值 = Σ (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

中证中高等级信用债指数样本每月调整一次，定期调整生效日为每月首个交易日，定期调整数据提取日为生效日前一个交易日。

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。