

中证 3 年期中高等级信用债指数编制方案

中证 3 年期中高等级信用债指数样本券由在交易所市场和银行间市场上市、剩余期限在 1 年以上，5 年以下且主体信用级别为 AA 及以上的信用债构成。指数采用市值加权计算，以反映相应期限、级别信用债的表现。

一、指数名称和代码

指数名称：中证 3 年期中高等级信用债指数

指数简称：3 年中高信用

英文名称：CSI 3-Year Medium-High Grade Credit Bond Index

英文简称：3-Year Medium-High Grade Credit Bond

指数代码：H11185

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

中证 3 年期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：在沪深交易所或银行间债券市场上市的企业债、公司债和中期票据等信用债品种，债券币种为人民币；

(2) 主体评级：AA 及以上；

(3) 债券剩余期限：1 年以上，5 年以下；

(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3年期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：

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

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3年期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第二个交易日。

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。