

## 中证公司债指数编制方案

中证公司债指数样本券由沪深交易所上市、剩余期限 1 年以上、信用级别为投资级以上的公司债券组成。指数采用市值加权计算，以反映沪深交易所公司债的整体表现。

### 一、指数名称和代码

指数名称：中证公司债指数

指数简称：公司债指

英文名称：CSI Enterprise Bond Index

英文简称：Enterprise Bond

指数代码：000923(上海)/399923(深圳)

### 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

中证公司债指数的样本空间由满足以下条件的债券构成：

（1）债券种类：在沪深交易所上市的公司债，其中不包括可分离债，债券币种为人民币；

（2）信用评级：投资级以上；

(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。

## 2、选样方法

选取样本空间内所有债券作为指数样本券。

## 四、指数计算

指数系列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 =  $\sum$ （全价 × 发行量），全价 = 净价 + 应计利息。

该指数计算用价格为交易价格，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

中证公司债指数样本每月定期调整一次，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

满足条件的新发债券自上市次日起进入指数。若样本券发生暂停上市、摘牌

等事件，视情况自事件生效之日起剔除出指数；样本券发生其他事件，参照计算与维护细则处理。