

中证政策性金融债指数系列编制方案

中证政策性金融债指数系列从交易所或银行间市场上市的债券中，选取对应剩余期限、发行人的政策性金融债作为指数样本，反映相应发行人及期限政策性金融债的市场表现。

一、指数名称和代码

指数名称	指数简称	英文名称	英文简称	指数代码
中证政策性金融债指数	政金债	CSI Policy Bank Bond Index	CSI Policy Bank Bond	930870
中证政策性金融债 0-1 年指数	政金债 0-1	CSI Policy Bank Bond 0-1Y Index	Policy Bank Bond 0-1Y	931274
中证政策性金融债 0-2 年指数	政金债 0-2	CSI Policy Bank Bond 0-2Y Index	Policy Bank Bond 0-2Y	932191
中证政策性金融债 0-3 年指数	政金债 0-3	CSI Policy Bank Bond 0-3Y Index	Policy Bank Bond 0-3Y	932192
中证政策性金融债 0-5 年指数	政金债 0-5	CSI Policy Bank Bond 0-5Y Index	Policy Bank Bond 0-5Y	932340
中证政策性金融债 1-3 年指数	政金债 1-3	CSI Policy Bank Bond 1-3Y Index	Policy Bank Bond 1-3Y	930871
中证政策性金融债 1-5 年指数	政金债 1-5	CSI Policy Bank Bond 1-5Y Index	Policy Bank Bond 1-5Y	931275
中证政策性金融债 3-5 年指数	政金债 3-5	CSI Policy Bank Bond 3-5Y Index	Policy Bank Bond 3-5Y	930872
中证政策性金融债 3-7 年指数	政金债 3-7	CSI Policy Bank Bond 3-7Y Index	Policy Bank Bond 3-7Y	932341
中证政策性金融债 5-8 年指数	政金债 5-8	CSI Policy Bank Bond 5-8Y Index	Policy Bank Bond 5-8Y	930873
中证政策性金融债 5-10 年指数	政金债 5-10	CSI Policy Bank Bond 5-10Y Index	Policy Bank Bond 5-10Y	931276
中证政策性金融债 8-10 年指数	政金债 8-10	CSI Policy Bank Bond 8-10Y Index	Policy Bank Bond 8-10Y	930874
中证政策性金融债 10+年指数	政金债 10+	CSI Policy Bank Bond 10Y Above	Policy Bank Bond 10Y Above	931277

中证政策性金融债 10-25 年指数	政金债 10-25	CSI Policy Bank Bond 10-25Y Index	Policy Bank Bond 10-25Y	931278
中证国开债指数	国开债	CSI CDB Bond Index	CDB Bond	931279
中证国开债 0-1 年指数	国开债 0-1	CSI CDB Bond 0-1Y Index	CDB Bond 0-1Y	931280
中证国开债 0-2 年指数	国开债 0-2	CSI CDB Bond 0-2Y Index	CDB Bond 0-2Y	932193
中证国开债 0-3 年指数	国开债 0-3	CSI CDB Bond 0-3Y Index	CDB Bond 0-3Y	932194
中证国开债 0-5 年指数	国开债 0-5	CSI CDB Bond 0-5Y Index	CDB Bond 0-5Y	932342
中证国开债 1-3 年指数	1-3 年国开债	CSI 1-3 Year CDB Bond Index	1-3 Year CDB Bond	931010
中证国开债 1-5 年指数	国开债 1-5	CSI CDB Bond 1-5Y Index	CDB Bond 1-5Y	931281
中证国开债 3-5 年指数	国开债 3-5	CSI CDB Bond 3-5Y Index	CDB Bond 3-5Y	931282
中证国开债 3-7 年指数	国开债 3-7	CSI CDB Bond 3-7Y Index	CDB Bond 3-7Y	932343
中证国开债 5-7 年指数	国开债 5-7	CSI CDB Bond 5-7Y Index	CDB Bond 5-7Y	931283
中证国开债 5-10 年指数	国开债 5-10	CSI CDB Bond 5- 10Y Index	CDB Bond 5-10Y	931284
中证国开债 10+ 年指数	国开债 10+	CSI CDB Bond 10Y Above Index	CDB Bond 10Y Above	931285
中证国开债 10-25 年指数	国开债 10-25	CSI CDB Bond 10-25Y Index	CDB Bond 10-25Y	931286
中证农发债指数	农发债	CSI ADBC Bond Index	ADBC Bond	931287
中证农发债 0-1 年指数	农发债 0-1	CSI ADBC Bond 0-1Y Index	ADBC Bond 0-1Y	931288
中证农发债 0-2 年指数	农发债 0-2	CSI ADBC Bond 0-2Y Index	ADBC Bond 0-2Y	932195
中证农发债 0-3 年指数	农发债 0-3	CSI ADBC Bond 0-3Y Index	ADBC Bond 0-3Y	932196
中证农发债 0-5 年指数	农发债 0-5	CSI ADBC Bond 0-5Y Index	ADBC Bond 0-5Y	932344
中证农发债 1-3 年指数	农发债 1-3	CSI ADBC Bond 1-3Y Index	ADBC Bond 1-3Y	931289
中证农发债 1-5 年指数	农发债 1-5	CSI ADBC Bond 1-5Y Index	ADBC Bond 1-5Y	931290
中证农发债 3-5 年指数	农发债 3-5	CSI ADBC Bond 3-5Y Index	ADBC Bond 3-5Y	931291
中证农发债 3-7 年	农发债 3-7	CSI ADBC Bond 3-7Y	ADBC Bond	932345

指数		Index	3-7Y	
中证农发债 5-7 年指数	农发债 5-7	CSI ADBC Bond 5-7Y Index	ADBC Bond 5-7Y	931292
中证农发债 5-10 年指数	农发债 5-10	CSI ADBC Bond 5-10Y Index	ADBC Bond 5-10Y	931293
中证农发债 7-10 年指数	农发债 7-10	CSI ADBC Bond 7-10Y Index	ADBC Bond 7-10Y	931294
中证进出口债指数	进出口债	CSI EIBC Bond Index	EIBC Bond	931295
中证进出口债 0-1 年指数	进出口债 0-1	CSI EIBC Bond 0-1Y Index	EIBC Bond 0-1Y	931296
中证进出口债 0-2 年指数	进出口债 0-2	CSI EIBC Bond 0-2Y Index	EIBC Bond 0-2Y	932197
中证进出口债 0-3 年指数	进出口债 0-3	CSI EIBC Bond 0-3Y Index	EIBC Bond 0-3Y	932198
中证进出口债 0-5 年指数	进出口债 0-5	CSI EIBC Bond 0-5Y Index	EIBC Bond 0-5Y	932346
中证进出口债 1-3 年指数	进出口债 1-3	CSI EIBC Bond 1-3Y Index	EIBC Bond 1-3Y	931297
中证进出口债 1-5 年指数	进出口债 1-5	CSI EIBC Bond 1-5Y Index	EIBC Bond 1-5Y	931298
中证进出口债 3-5 年指数	进出口债 3-5	CSI EIBC Bond 3-5Y Index	EIBC Bond 3-5Y	931299
中证进出口债 3-7 年指数	进出口债 3-7	CSI EIBC Bond 3-7Y Index	EIBC Bond 3-7Y	932347
中证进出口债 5-7 年指数	进出口债 5-7	CSI EIBC Bond 5-7Y Index	EIBC Bond 5-7Y	931300
中证进出口债 5-10 年指数	进出口债 5-10	CSI EIBC Bond 5-10Y Index	EIBC Bond 5-10Y	931301
中证进出口债 7-10 年指数	进出口债 7-10	CSI EIBC Bond 7-10Y Index	EIBC Bond 7-10Y	931302

二、指数基日和基点

指数代码	指数简称	基日	基点
930870	政金债	2007/12/31	100
931274	政金债 0-1	2007/12/31	100
932191	政金债 0-2	2007/12/31	100
932192	政金债 0-3	2007/12/31	100
932340	政金债 0-5	2007/12/31	100
930871	政金债 0-3	2007/12/31	100
931275	政金债 1-5	2007/12/31	100
930872	政金债 3-5	2007/12/31	100

932341	政金债 3-7	2007/12/31	100
930873	政金债 5-8	2007/12/31	100
931276	政金债 5-10	2007/12/31	100
930874	政金债 8-10	2007/12/31	100
931277	政金债 10+	2007/12/31	100
931278	政金债 10-25	2007/12/31	100
931279	国开债	2007/12/31	100
931280	国开债 0-1	2007/12/31	100
932193	国开债 0-2	2007/12/31	100
932194	国开债 0-3	2007/12/31	100
932342	国开债 0-5	2007/12/31	100
931010	1-3 年国开债	2007/12/31	100
931281	国开债 1-5	2007/12/31	100
931282	国开债 3-5	2007/12/31	100
932343	国开债 3-7	2007/12/31	100
931283	国开债 5-7	2007/12/31	100
931284	国开债 5-10	2007/12/31	100
931285	国开债 10+	2007/12/31	100
931286	国开债 10-25	2007/12/31	100
931287	农发债	2007/12/31	100
931288	农发债 0-1	2007/12/31	100
932195	农发债 0-2	2007/12/31	100
932196	农发债 0-3	2007/12/31	100
932344	农发债 0-5	2007/12/31	100
931289	农发债 1-3	2007/12/31	100
931290	农发债 1-5	2007/12/31	100
931291	农发债 3-5	2007/12/31	100
932345	农发债 3-7	2007/12/31	100
931292	农发债 5-7	2007/12/31	100
931293	农发债 5-10	2007/12/31	100
931294	农发债 7-10	2007/12/31	100
931295	进出口债	2007/12/31	100
931296	进出口债 0-1	2007/12/31	100
932197	进出口债 0-2	2007/12/31	100
932198	进出口债 0-3	2007/12/31	100
932346	进出口债 0-5	2007/12/31	100
931297	进出口债 1-3	2007/12/31	100
931298	进出口债 1-5	2007/12/31	100
931299	进出口债 3-5	2007/12/31	100
932347	进出口债 3-7	2007/12/31	100
931300	进出口债 5-7	2008/12/31	100
931301	进出口债 5-10	2008/12/31	100

931302	进出口债 7-10	2011/12/31	100
--------	-----------	------------	-----

三、样本选取方法

1、样本空间

该指数系列的样本空间由满足以下条件的债券构成：

(1) 债券种类：在交易所或银行间市场上市的政策性金融债，不包括私募品种，债券币种为人民币；

(2) 付息方式：固定利率付息或一次还本付息。

2、选样方法

选取样本空间中剩余期限和发行人符合如下条件的债券作为各指数样本：

指数代码	指数简称	剩余期限	发行人
930870	政金债	1 年及以上	无限制
931274	政金债 0-1	1 年及以下	无限制
932191	政金债 0-2	2 年及以下	无限制
932192	政金债 0-3	3 年及以下	无限制
932340	政金债 0-5	5 年及以下	无限制
930871	政金债 1-3	0.8 年及以上，3 年以下	无限制
931275	政金债 1-5	6 个月以上，5 年及以下	无限制
930872	政金债 3-5	2.5 年及以上，5 年以下	无限制
932341	政金债 3-7	3 年及以上，7 年以下	无限制
930873	政金债 5-8	4.5 年及以上，8 年以下	无限制
931276	政金债 5-10	4.5 年以上，10 年及以下	无限制
930874	政金债 8-10	7.5 年及以上，10 年以下	无限制
931277	政金债 10+	9.5 年及以上	无限制
931278	政金债 10-25	9.5 年以上，25 年及以下	无限制
931279	国开债	1 年以上	国家开发银行
931280	国开债 0-1	1 年及以下	国家开发银行
932193	国开债 0-2	2 年及以下	国家开发银行
932194	国开债 0-3	3 年及以下	国家开发银行
932342	国开债 0-5	5 年及以下	国家开发银行
931010	1-3 年国开债	6 个月以上，3 年及以下	国家开发银行
931281	国开债 1-5	6 个月以上，5 年及以下	国家开发银行
931282	国开债 3-5	2.5 年以上，5 年及以下	国家开发银行

932343	国开债 3-7	3 年以上, 7 年及以下	国家开发银行
931283	国开债 5-7	4.5 年以上, 7 年及以下	国家开发银行
931284	国开债 5-10	4.5 年以上, 10 年及以下	国家开发银行
931285	国开债 10+	9.5 年以上	国家开发银行
931286	国开债 10-25	9.5 年以上, 25 年及以下	国家开发银行
931287	农发债	1 年以上	中国农业发展银行
931288	农发债 0-1	1 年及以下	中国农业发展银行
932195	农发债 0-2	2 年及以下	中国农业发展银行
932196	农发债 0-3	3 年及以下	中国农业发展银行
932344	农发债 0-5	5 年及以下	中国农业发展银行
931289	农发债 1-3	6 个月以上, 3 年及以下	中国农业发展银行
931290	农发债 1-5	6 个月以上, 5 年及以下	中国农业发展银行
931291	农发债 3-5	2.5 年以上, 5 年及以下	中国农业发展银行
932345	农发债 3-7	3 年以上, 7 年及以下	中国农业发展银行
931292	农发债 5-7	4.5 年以上, 7 年及以下	中国农业发展银行
931293	农发债 5-10	4.5 年以上, 10 年及以下	中国农业发展银行
931294	农发债 7-10	6.5 年以上, 10 年及以下	中国农业发展银行
931295	进出口债	1 年以上	中国进出口银行
931296	进出口债 0-1	1 年及以下	中国进出口银行
932197	进出口债 0-2	2 年及以下	中国进出口银行
932198	进出口债 0-3	3 年及以下	中国进出口银行
932346	进出口债 0-5	5 年及以下	中国进出口银行
931297	进出口债 1-3	6 个月以上, 3 年及以下	中国进出口银行
931298	进出口债 1-5	6 个月以上, 5 年及以下	中国进出口银行
931299	进出口债 3-5	2.5 年以上, 5 年及以下	中国进出口银行
932347	进出口债 3-7	3 年以上, 7 年及以下	中国进出口银行
931300	进出口债 5-7	4.5 年以上, 7 年及以下	中国进出口银行
931301	进出口债 5-10	4.5 年以上, 10 年及以下	中国进出口银行
931302	进出口债 7-10	6.5 年以上, 10 年及以下	中国进出口银行

四、指数计算

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, 报告期样本总市值 = $\sum [(\text{净价} + \text{应计利息}) \times \text{发行量}]$

指数计算用价格为中证估值价格, 其他计算用数据、除数调整参见计算与维

护细则。

五、样本调整

1、定期调整

该指数系列样本每月调整一次，定期调整生效日为每月首个交易日，定期调整数据截止日为生效日前一交易日。

2、临时调整

满足条件的新发债券自上市次日起进入指数。若样本发生摘牌等事件，视情况自事件生效之日起剔除出指数；样本发生其他事件，参照计算与维护细则处理。