

中证高等级综合债指数系列编制方案

中证高等级综合债指数系列从交易所及银行间市场上市的债券中，选取对应细分剩余期限的国债、地方政府债、政策性银行债及高等级信用债作为指数样本，以反映相应综合债的整体表现。

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
中证高等级综合债指数	高等级综合债	CSI High Grade Aggregate Bond Index	High Grade Aggregate	932691
中证短期高等级综合债指数	短期高等级综合债	CSI Short Term High Grade Aggregate Bond Index	Short Term High Grade Aggregate	932692
中证 0-3 年高等级综合债指数	0-3 高等级综合债	CSI 0-3 Year High Grade Aggregate Bond Index	0-3 High Grade Aggregate	932693
中证 0-5 年高等级综合债指数	0-5 高等级综合债	CSI 0-5 Year High Grade Aggregate Bond Index	0-5 High Grade Aggregate	932694
中证 0-7 年高等级综合债指数	0-7 高等级综合债	CSI 0-7 Year High Grade Aggregate Bond Index	0-7 High Grade Aggregate	932695
中证 1-3 年高等级综合债指数	1-3 高等级综合债	CSI 1-3 Year High Grade Aggregate Bond Index	1-3 High Grade Aggregate	932696
中证 1-5 年高等级综合债指数	1-5 高等级综合债	CSI 1-5 Year High Grade Aggregate Bond Index	1-5 High Grade Aggregate	932697
中证 3-5 年高等级综合债指数	3-5 高等级综合债	CSI 3-5 Year High Grade Aggregate Bond Index	3-5 High Grade Aggregate	932698
中证 3-7 年高等级综合债指数	3-7 高等级综合债	CSI 3-7 Year High Grade Aggregate Bond Index	3-7 High Grade Aggregate	932699
中证 5-7 年高等级综合债指数	5-7 高等级综合债	CSI 5-7 Year High Grade Aggregate Bond Index	5-7 High Grade Aggregate	932700
中证 5-10 年高等级综合债指数	5-10 高等级综合债	CSI 5-10 Year High Grade Aggregate Bond Index	5-10 High Grade Aggregate	932701
中证 7-10 年高等级综合债指数	7-10 高等级综合债	CSI 7-10 Year High Grade Aggregate Bond Index	7-10 High Grade Aggregate	932702
中证 10 年以上高等级综合债指数	10+高等级综合债	CSI 10 Year Above High Grade Aggregate Bond Index	10 Above High Grade Aggregate	932703

二、指数基日和基点

指数系列以 2018 年 12 月 28 日为基日，以 100 点为基点。

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：在交易所及银行间市场上市的国债、地方政府债、金融债、中期票据、短期融资券、公司债、企业债等，不含私募债，债券币种为人民币。

(2) 付息方式：固定利率付息和一次还本付息。

2、选样方法

在样本空间中，选取剩余期限与信用评级满足如下条件的债券作为指数样本；

指数代码	指数简称	剩余期限	信用等级
932691	高等级综合债	无限制	国债、地方政府债及政策性银行债： 无限制； 其余债券：信用债主体评级为 AA+及以上，隐含评级为 AA 及以上
932692	短期高等级综合债	397 天及以下	
932693	0-3 高等级综合债	3 年及以下	
932694	0-5 高等级综合债	5 年及以下	
932695	0-7 高等级综合债	7 年及以下	
932696	1-3 高等级综合债	1 年以上，3 年及以下	
932697	1-5 高等级综合债	1 年以上，5 年及以下	
932698	3-5 高等级综合债	3 年以上，5 年及以下	
932699	3-7 高等级综合债	3 年以上，7 年及以下	
932700	5-7 高等级综合债	5 年以上，7 年及以下	
932701	5-10 高等级综合债	5 年以上，10 年及以下	

932702	7-10 高等级综合债	7 年以上, 10 年及以下	
932703	10+高等级综合债	10 年以上	

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

该指数系列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

指数系列每月调整一次, 定期调整生效日为每月首个交易日。

2、临时调整

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。