

中证交易所 AAA 综合债指数系列编制方案

中证交易所 AAA 综合债指数系列从交易所市场上市的债券中，选取剩余期限、信用评级符合条件的债券作为指数样本，以反映交易所市场相应债券的整体表现。

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
中证交易所 AAA 综合债指数	交易所 AAA 综合债	CSI Exchange AAA Aggregate Bond Index	Exchange AAA Aggregate	932704
中证交易所短期 AAA 综合债指数	交易所短期 AAA 综合债	CSI Exchange Short Term AAA Aggregate Bond Index	Exchange Short Term AAA Aggregate	932705
中证交易所 0-3 年 AAA 综合债指数	交易所 0-3AAA 综合债	CSI Exchange 0-3 Year AAA Aggregate Bond Index	Exchange 0-3 AAA Aggregate	932706
中证交易所 0-5 年 AAA 综合债指数	交易所 0-5AAA 综合债	CSI Exchange 0-5 Year AAA Aggregate Bond Index	Exchange 0-5 AAA Aggregate	932707
中证交易所 0-7 年 AAA 综合债指数	交易所 0-7AAA 综合债	CSI Exchange 0-7 Year AAA Aggregate Bond Index	Exchange 0-7 AAA Aggregate	932708
中证交易所 0-10 年 AAA 综合债指数	交易所 0-10AAA 综合债	CSI Exchange 0-10 Year AAA Aggregate Bond Index	Exchange 0-10AAA Aggregate	932709
中证交易所 3-5 年 AAA 综合债指数	交易所 3-5AAA 综合债	CSI Exchange 3-5 Year AAA Aggregate Bond Index	Exchange 3-5 AAA Aggregate	932710
中证交易所 5-7 年 AAA 综合债指数	交易所 5-7AAA 综合债	CSI Exchange 5-7 Year AAA Aggregate Bond Index	Exchange 5-7 AAA Aggregate	932711
中证交易所 5-10 年 AAA 综合债指数	交易所 5-10AAA 综合债	CSI Exchange 5-10 Year AAA Aggregate Bond Index	Exchange 5-10 AAA Aggregate	932712
中证交易所 7-10 年 AAA 综合债指数	交易所 7-10AAA 综合债	CSI Exchange 7-10 Year AAA Aggregate Bond Index	Exchange 7-10 AAA Aggregate	932713
中证交易所 10 年以	交易所	CSI Exchange 10 Year	Exchange 10+ AAA	932714

上 AAA 综合债指数	10+AAA 综合债	Above AAA Aggregate Bond Index	Aggregate	
-------------	------------	--------------------------------	-----------	--

二、指数基日和基点

该指数系列以 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

指数系列的样本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下述债券，不含私募品种，债券币种为人民币：

利率类债券：国债、地方政府债、政策性金融债等；

信用类债券：公司债、企业债、中期票据、短期融资券、非政策性金融债等；

(2) 付息方式：固定利率付息或一次还本付息；

(3) 信用评级：利率类债券：无限制；信用类债券：主体评级 AAA，中证隐含评级 AA+及以上。

2、选样方法

在样本空间内，选取交易所市场上市符合下列条件的债券作为指数样本。

指数代码	指数简称	剩余期限
932704	交易所 AAA 综合债	无限制
932705	交易所短期 AAA 综合债	397 天及以下
932706	交易所 0-3AAA 综合债	3 年及以下
932707	交易所 0-5AAA 综合债	5 年及以下
932708	交易所 0-7AAA 综合债	7 年及以下
932709	交易所 0-10AAA 综合债	10 年及以下
932710	交易所 3-5AAA 综合债	3 年以上，5 年及以下

932711	交易所 5-7AAA 综合债	5 年以上, 7 年及以下
932712	交易所 5-10AAA 综合债	5 年以上, 10 年及以下
932713	交易所 7-10AAA 综合债	7 年以上, 10 年及以下
932714	交易所 10+AAA 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, 报告期样本总市值 = $\sum[(\text{净价} + \text{应计利息}) \times \text{发行量} \times \text{权重因子}]$

该指数系列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。权重因子介于 0 和 1 之间, 以使以各指数利率类债券样本合计权重与样本空间对应剩余期限利率类债券的总市值占比保持一致。

五、样本调整

1、定期调整

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。

权重因子随样本定期调整而调整, 调整时间与指数样本定期调整实施时间相同。在下一个定期调整日前, 权重因子一般固定不变。

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。