

国证企业债指数编制方案

(2015年1月修订)

为满足证券市场衡量企业债投资收益的需求,结合国内实际情况并参照国际惯例,编制国证企业债指数。

一、 指数代码与名称

指数代码: 399481

指数简称: 企债指数

指数中文全称: 国证企业债指数

指数英文名称: CNI CORPORATE BOND INDEX

二、 基日与基点

国证企业债指数以 2002 年 12 月 31 日为基日,基日指数为 100。

三、 选股原则

在交易所上市交易且符合下列条件的企业债券,选为成份债券,纳入指数计算范畴:

1. 非 ST 的企业债券;
2. 固定利率且不附带转股、优先购买股票权利的企业债券;
3. 剩余期限在一年以上(含一年)的企业债券。

四、 指数计算方法

国证企业债指数采用派氏加权法编制,采用下列公式逐日连锁计

算指数：

报告日指数 =

$$\text{报告日指数} = \frac{\text{上一交易日收市指数} \times \frac{\sum (\text{成份股实时成交价} \times \text{成份股权数})}{\sum (\text{成份股上一交易日收市价} \times \text{成份股权数})}}{\sum (\text{成份股上一交易日收市价} \times \text{成份股权数})}$$

五、 指数的调整计算

1. 实时调整

成份债券出现付息情况时，在除息日将分母中该成份债券的收市价更新为除息参考价（除息参考价以深圳和上海证券交易所计算为准）。

2. 定期调整

国证企业债指数样本定于每年 1 月、7 月的第一个交易日进行定期调整，通常在前一年的 12 月和当年的 6 月的第二个完整交易周的第一个交易日提前公布样本调整方案。

需对成份债券进行调整的情况如下所示：

- (1) 新的企业债券发行上市且符合选取原则时，调入指数；
- (2) 成份债券剩余期限不足一年或被实行 ST 时，调出指数。

六、 指数的发布与管理

国证企业债指数由深圳证券信息有限公司编制、维护和发布。国证企业债指数属于深圳证券信息有限公司资产，未经公司同意，任何单位或个人不得跟踪、交易该指数，或以该指数为评价基准。

七、 免责声明

本文件和其中的所有信息，包括但不限于所有的文字、数据、图表、表格属于深圳证券信息有限公司的财产，受中国知识产权法律及相关法律保护。未经深圳证券信息有限公司书面许可，不得将这些信息全部或部分复制或再次传播。

本文件及其中任何信息均不构成任何证券、金融产品或其他投资工具或任何交易策略的依据或建议，也不表示深圳证券信息有限公司及其关联方关于任何发行人、证券、金融产品或工具或交易策略的意见。

对任何直接或间接使用本文件及其任何信息而造成的损失，包括但不限于因内容不准确、不完整而导致的损失，深圳证券信息公司及其关联方无须承担任何法律责任。