

平安中债-5-10 年期国开债活跃券指数概览

2018 年 1 月

指数简介

- 平安中债-5-10 年期国开债活跃券指数 Pingan ChinaBond 5-10 Year Liquid CDB Bond Index

平安中债-5-10 年期国开债活跃券指数隶属于中债定制指数族分类，该指数样本券由国家开发银行在全国银行间债券市场发行的 5 年期、7 年期和 10 年期政策性银行债组成，指数样本券权重根据样本券的发行余额、上市时间和剩余期限三个因子调整，旨在为广大投资者提供一个可投资复制 5-10 年期国开债走势的业绩基准和跟踪标的。

待偿期分段子指数：无

指数历史表现



财富指数回报率

| 财富指数回报率 | 1 个月 | 3 个月 | 6 个月 | 1 年 | 3 年 |
|----------------------|-------|--------|--------|--------|-------|
| 平安中债-5-10 年期国开债活跃券指数 | 0.13% | -2.30% | -1.90% | -2.99% | 5.02% |

财富指数年化回报率

| 财富指数回报率 | 1 个月 | 3 个月 | 6 个月 | 1 年 | 3 年 |
|----------------------|-------|--------|--------|--------|-------|
| 平安中债-5-10 年期国开债活跃券指数 | 1.59% | -8.87% | -3.75% | -2.99% | 1.65% |

数据来源：中债金融估值中心有限公司（截至至 2017 年 12 月 31 日）

编制说明

| | |
|------|-----------------|
| 基期 | 2013 年 6 月 30 日 |
| 计息方式 | 附息式固定利率 |
| 币种 | 人民币 |
| 含权债 | 不包括含权债 |
| 计算频率 | 每个银行间工作日 |
| 指数调整 | 每月调整 |

债券种类

政策性银行债，不包括绿色债券和其他特别债券

发行人

国家开发银行

发行期限

5 年、7 年、10 年

流通场所

全国银行间债券市场

指数代码

| | |
|------|----------|
| 中债 | CBC00601 |
| 彭博 | 待定 |
| 汤森路透 | 待定 |

联系人：

姜俊飞 +86-10-88170643
jiangjf@chinabond.com.cn
刘晓逸 +86-10-88170649
liuxy@chinabond.com.cn
葛量 +86-10-88170664
geliang@chinabond.com.cn

www.chinabond.com.cn

重要声明：
本文件所载信息皆来源于已公开的资料或中债金融估值中心有限公司人员的个人分析。我公司不保证上述信息的完整与准确性，不因使用本报告产生的一切后果承担责任，只供市场成员参考。中债金融估值中心有限公司版权所有并保留一切权利。如果您对中债收益率曲线和指数有任何疑问或相关建议，欢迎致函或致电中债金融估值中心有限公司反映问题和交流看法。

©中债金融估值中心有限公司 2018。版权所有

样本券特征

| 指数特征 | 平安中债-5-10 年期国开债活跃券指数 |
|-------------|----------------------|
| 样本券数量 | 8 |
| 指数总市值 (亿元) | 11779 |
| 平均久期 (年) | 5.52 |
| 平均到期收益率 (%) | 4.89 |
| 平均待偿期 (年) | 6.73 |
| 平均派息率 (%) | 4.09 |

平安中债-5-10 年期国开债活跃券指数样本券

| 债券代码 | 债券简称 | 流通场所 | 债券类型 | 全价市值权重(%) |
|--------|----------|---------|---------|-----------|
| 170206 | 17 国开 06 | 银行间债券市场 | 政策性银行债券 | 32.90 |
| 170208 | 17 国开 08 | 银行间债券市场 | 政策性银行债券 | 23.63 |
| 170215 | 17 国开 15 | 银行间债券市场 | 政策性银行债券 | 19.25 |
| 170210 | 17 国开 10 | 银行间债券市场 | 政策性银行债券 | 11.31 |
| 170201 | 17 国开 01 | 银行间债券市场 | 政策性银行债券 | 9.61 |
| 160213 | 16 国开 13 | 银行间债券市场 | 政策性银行债券 | 2.20 |
| 160210 | 16 国开 10 | 银行间债券市场 | 政策性银行债券 | 0.62 |
| 160218 | 16 国开 18 | 银行间债券市场 | 政策性银行债券 | 0.47 |

数据来源：中债金融估值中心有限公司（截至于 2017 年 12 月 31 日）

重要声明：

本文件所载信息皆来源于已公开的资料或中债金融估值中心有限公司人员的个人分析。我公司不保证上述信息的完整与准确性，不因使用本报告产生的一切后果承担责任，只供市场成员参考。中债金融估值中心有限公司版权所有并保留一切权利。如果您对中债收益率曲线和指数有任何疑问或相关建议，欢迎致函或致电中债金融估值中心有限公司反映问题和交流看法。