

附件 6

ICS 35.240.40

CCS A 11

JR

中华人民共和国金融行业标准

JR/T 0229—2021

债券价格指标产品描述规范

Specification of description for bond pricing indicator products

2021 - 07 - 22 发布

2021 - 07 - 22 实施

中国人民银行 发布

目 次

前言.....	II
1 范围.....	1
2 规范性引用文件.....	1
3 术语和定义.....	1
4 债券价格指标产品框架.....	2
5 数据元表示格式.....	2
6 数据元要素定义.....	3
6.1 债券收益率曲线类.....	3
6.2 债券估值类.....	4
6.3 债券指数类.....	9
6.4 债券风险价值类.....	17
参考文献.....	19

前 言

本文件按照GB/T 1.1—2020《标准化工作导则 第1部分：标准化文件的结构和起草规则》的规定起草。

请注意本文件的某些内容可能涉及专利。本文件的发布机构不承担识别专利的责任。

本文件由中央国债登记结算有限责任公司提出。

本文件由全国金融标准化技术委员会（SAC/TC 180）归口。

本文件起草单位：中央国债登记结算有限责任公司、中债金融估值中心有限公司、中国外汇交易中心暨全国银行间同业拆借中心、银行间市场清算所股份有限公司、中国证券投资基金业协会、中国工商银行股份有限公司、中国农业银行股份有限公司、中国银行股份有限公司、中国建设银行股份有限公司、上海浦东发展银行股份有限公司、易方达基金管理有限公司、中证指数有限公司、上海大智慧财汇数据科技有限公司、万得信息技术股份有限公司、路孚特信息服务（中国）有限公司、彭博资讯（北京）有限公司。

本文件主要起草人：牛玉锐、郑英立、王超群、赵凌、孙明洁、黄山、廖倩芸、魏成、徐超、马彤、周小丽、金昌骏、张兆嘉、熊歆、汤玥玥、赵丽、刘瑞丰、纪伟伟、苏晓航、张苏林、宋震、马骏、何真、孙涛、陈映洲、史海雄、周立、程海波、蔡骏胜、诸赞松、蒋瑞杰。

债券价格指标产品描述规范

1 范围

本文件规定了债券价格指标产品各要素的定义、范围及输出口径。
本文件适用于债券价格指标产品的编制发布机构及使用机构。

2 规范性引用文件

下列文件中的内容通过文中的规范性引用而构成本文件必不可少的条款。其中，注日期的引用文件，仅该日期对应的版本适用于本文件；不注日期的引用文件，其最新版本（包括所有的修改单）适用于本文件。

JR/T 0065—2019 银行间市场基础数据元

3 术语和定义

JR/T 0065—2019界定的以及下列术语和定义适用于本文件。

3.1

可枚举值域 enumerated value domain

规定全部允许值列表的值域。

[来源：GB/T 18391—2009，3.3.13]

3.2

债券 bond

反映债权债务关系的凭证，用以证明发行人有义务通过提供现金或金融工具等进行偿付，在一定程度上可以流通的金融工具。

3.3

债券收益率曲线 bond yield curve

反映一组货币和信用风险均相同，但期限不同的债券收益率值的连线。

3.4

债券估值 bond valuation

以市场价格信息为基础加工生成的，反映公平交易下特定时间点的可变现参考价格及一系列相关指标。

3.5

债券指数 bond index

反映某一类债券组合价格走势的指标体系。

3.6

债券风险价值 bond Value at Risk; bond VaR

用于揭示某一只债券或者债券组合在未来持有期内可能存在的头寸损失的相关指标。

4 债券价格指标产品框架

债券价格指标产品覆盖债券收益率曲线、债券估值、债券指数和债券风险价值四大类，见下图。



图 债券价格指标产品框架

债券收益率曲线类价格指标产品包含各类能反映当前债券市场上不同信用等级、不同期限利率水平的曲线族系。具体包括收益率曲线类型、收益率曲线期限等数据元。

债券估值类价格指标产品具体包括债券日间估价全价、债券日间应计利息、债券估价净价、债券到期收益率、债券市场隐含评级等数据元。

债券指数类价格指标产品包含债券指数指标要素和债券指数样本券信息要素。具体包括指数值、指数久期、指数样本券到期收益率、指数样本券应计利息等数据元。

债券风险价值类价格指标产品揭示某一只债券或者债券组合在未来持有期内可能存在的市场风险。具体包括风险价值、条件风险价值、持有期、置信水平等数据元。

5 数据元表示格式

本文件的债券价格指标产品数据元，应按照以下结构和内容进行规范：

——名称：数据元的名称，必填。

——英文名称：数据元的英文名称，必填。每个英文单词之间无间隔，且每个主要英文单词首字母大写。

——编号：数据元在本文件中的唯一编号，按照债券价格指标产品框架进行顺序编号，并适当留有一定的扩展空间，必填。编号为四位，第1位为大写英文字母，表示债券价格指标产品大类，按照英文字母正序排列。第2位为债券价格指标产品大类中细分要素的序号。第3、4位为债券价格指标产品大类或要素中数据元的序号。

——定义：数据元的含义，必填。

——数据类型：数据元的取值类型，必填。

——可枚举值域：用于规定当数据元可被枚举时，可供枚举的数据元值域，非必填。

——度量单位：数据元中数字型取值的单位，必填。若没有度量单位，填写无。

6 数据元要素定义

6.1 债券收益率曲线类

6.1.1 曲线编码

名称：曲线编码

英文名称：CurveCode

编号：A001

定义：收益率曲线的编码标识信息

数据类型：字符型

度量单位：无

6.1.2 曲线名称

名称：曲线名称

英文名称：CurveName

编号：A002

定义：收益率曲线的文字标识信息

数据类型：字符型

度量单位：无

6.1.3 日期

名称：日期

英文名称：Date

编号：A003

定义：债券价格指标产品计算对应的日期，格式为 YYYY-MM-DD

数据类型：日期型

度量单位：无

6.1.4 收益率曲线类型

名称：收益率曲线类型

英文名称: YieldCurveType

编号: A004

定义: 反映收益率与期限之间关系的曲线的类型

数据类型: 字符型

可枚举值域: 到期收益率曲线、即期收益率曲线、远期的到期收益率曲线、远期的即期收益率曲线

度量单位: 无

6.1.5 收益率曲线期限

名称: 收益率曲线期限

英文名称: Tenor

编号: A005

定义: 收益率曲线的不同期限值

数据类型: 数字型

度量单位: 年

6.1.6 曲线收益率

名称: 曲线收益率

英文名称: CurveYield

编号: A006

定义: 收益率曲线不同期限所对应的收益率数值

注: 当曲线为浮动利率点差收益率曲线时, 指不同期限所对应的点差收益率数值。

数据类型: 数字型

度量单位: %

6.1.7 浮动利率曲线基准利率值

名称: 浮动利率曲线基准利率值

英文名称: BenchmarkRateofFloatRateYieldCurve

编号: A007

定义: 浮动利率点差收益率曲线对应的基准利率数值

数据类型: 数字型

度量单位: %

6.2 债券估值类

6.2.1 债券代码

名称: 债券代码

英文名称: BondCode

编号: B001

定义: 按照 JR/T 0065—2019, 即债券流通托管机构公布的债券代码

数据类型: 字符型

度量单位: 无

6.2.2 债券简称

名称: 债券简称

英文名称: BondShortName

编号: B002

定义: 按照 JR/T 0065—2019, 即债券的简称

数据类型: 字符型

度量单位: 无

6.2.3 日期

名称: 日期

英文名称: Date

编号: 同 6.1.3 的编号

定义: 同 6.1.3 的定义

数据类型: 日期型

度量单位: 无

6.2.4 流通场所

名称: 流通场所

英文名称: Exchange

编号: B003

定义: 债券交易的场所

数据类型: 字符型

可枚举值域: 银行间债券市场、商业银行柜台市场、深圳证券交易所、上海证券交易所、上海自贸区债券市场、北京金融资产交易所、其他

度量单位: 无

6.2.5 债券计价币种

名称: 债券计价币种

英文名称: BondPricingDenominatedCurrency

编号: B004

定义: 债券估价的计价币种

数据类型: 字符型

可枚举值域: 美元 USD、欧元 EUR、日元 JPY、港元 HKD、英镑 GBP、人民币 CNY、其他

度量单位: 无

6.2.6 债券待偿期

名称: 债券待偿期

英文名称: BondMaturity

编号: B005

定义: 债券的剩余期限, 即债券价格指标产品计算日至债券价格指标产品到期日之间的期限

数据类型: 数字型

度量单位: 日、月、年

6.2.7 债券日间估价全价

名称: 债券日间估价全价

英文名称: BondPricingIntra-dayFullPrice
编号: B006
定义: 不包含估值当日应计利息的债券估价全价
数据类型: 数字型
度量单位: 与债券计价币种配合使用

6.2.8 债券日间应计利息

名称: 债券日间应计利息
英文名称: BondIntra-dayAccruedInterest
编号: B007
定义: 付息期起始日到估值日前一日的时段内累计增长的利息, 即不包含估值日当日应计利息的累计利息
数据类型: 数字型
度量单位: 与债券计价币种配合使用

6.2.9 债券估价净价

名称: 债券估价净价
英文名称: BondPricingFlatPrice
编号: B008
定义: 债券估价全价扣除持有期债券应计利息后的估值价格
数据类型: 数字型
度量单位: 与债券计价币种配合使用

6.2.10 债券到期收益率

名称: 债券到期收益率
英文名称: BondYieldtoMaturity; BondYTM
编号: B009
定义: 债券估价所对应的到期收益率
数据类型: 数字型
度量单位: %

6.2.11 债券估价修正久期

名称: 债券估价修正久期
英文名称: BondModifiedDuration
编号: B010
定义: 估价收益率变动 100 个基点时, 债券估价变动的近似百分比
数据类型: 数字型
度量单位: 无

6.2.12 债券估价凸性

名称: 债券估价凸性
英文名称: BondConvexity
编号: B011

定义：估价收益率变动 100 个基点时，债券估价变化率变动的近似百分比

数据类型：数字型

度量单位：无

6.2.13 债券估价基点价值

名称：债券估价基点价值

英文名称：BondBasisPointValue; BondBPV

编号：B012

定义：估价收益率变动一个基点时，债券估价的变动绝对值

数据类型：数字型

度量单位：无

6.2.14 债券估价利差久期

名称：债券估价利差久期

英文名称：BondSpreadDuration

编号：B013

定义：估价利差收益率变动 100 个基点时，浮动利率债券估价变动的近似百分比

数据类型：数字型

度量单位：无

6.2.15 债券估价利差凸性

名称：债券估价利差凸性

英文名称：BondSpreadConvexity

编号：B014

定义：估价利差收益率变动 100 个基点时，浮动利率债券估价变化率变动的近似百分比

数据类型：数字型

度量单位：无

6.2.16 债券估价利率久期

名称：债券估价利率久期

英文名称：BondRateDuration

编号：B015

定义：基准利率变动 100 个基点时，浮动利率债券估价变动的近似百分比

数据类型：数字型

度量单位：无

6.2.17 债券估价利率凸性

名称：债券估价利率凸性

英文名称：BondRateConvexity

编号：B016

定义：基准利率变动 100 个基点时，浮动利率债券估价变化率变动的近似百分比

数据类型：数字型

度量单位：无

6.2.18 债券日终估价全价

名称：债券日终估价全价

英文名称：BondPricingEndofDayFullPrice

编号：B017

定义：包含估值当日应计利息的债券估价全价

数据类型：数字型

度量单位：与债券计价币种配合使用

6.2.19 债券日终应计利息

名称：债券日终应计利息

英文名称：BondEndofDayAccruedInterest

编号：B018

定义：付息期起始日到估值日当日的时段内累计增长的利息，即包含估值日当日应计利息的累计利息

数据类型：数字型

度量单位：与债券计价币种配合使用

6.2.20 债券剩余本金

名称：债券剩余本金

英文名称：BondRemainingPrincipal

编号：B019

定义：当前估值日期仍未兑付的债券本金

数据类型：数字型

度量单位：与债券计价币种配合使用

6.2.21 浮动利率债券估值点差收益率

名称：浮动利率债券估值点差收益率

英文名称：FloatRateBondYield

编号：B020

定义：浮动利率债券到期收益率减去基准利率

数据类型：数字型

度量单位：%

6.2.22 估算的行权后票面利率

名称：估算的行权后票面利率

英文名称：EstimatedCouponRateafterExerciseDay

编号：B021

定义：根据当前收益率推导得到的行权后的票面利率，用于含有投资人回售权和发行人调整票面利率选择权的附息式固定利率债券估值

数据类型：数字型

度量单位：%

6.2.23 债券市场隐含评级

名称：债券市场隐含评级

英文名称：MarketImpliedRating

编号：B022

定义：从市场价格信号和发行主体相关信息等因素中提炼出的动态反映市场投资者对债券的信用评级

数据类型：字符型

度量单位：无

6.3 债券指数类

6.3.1 债券指数指标要素

6.3.1.1 指数代码

名称：指数代码

英文名称：IndexTicker

编号：C001

定义：指数的代码标识信息

数据类型：字符型

度量单位：无

6.3.1.2 指数名称

名称：指数名称

英文名称：IndexName

编号：C002

定义：为指数赋予的名称

数据类型：字符型

度量单位：无

6.3.1.3 指数指标生效日期

名称：指数指标生效日期

英文名称：EffectiveDateofIndexIndicator

编号：C003

定义：按照 JR/T 0065—2019，即指数指标在系统中可使用的日期，格式为 YYYY-MM-DD

数据类型：日期型

度量单位：无

6.3.1.4 指数值

名称：指数值

英文名称：IndexLevel

编号：C004

定义：根据指数样本券价格涨跌计算得到的表征该组样本券的价格水平的数值

数据类型：数字型

度量单位：无

6.3.1.5 待偿期分段

名称：待偿期分段

英文名称：CurrentMaturityInterval

编号：C005

定义：指数样本券的待偿期区间

数据类型：字符型

可枚举值域：总值、1年以下、1年（含）至3年、3年（含）至5年、5年（含）至7年、7年（含）至10年、10年（含）以上、其他

度量单位：无

6.3.1.6 指数计价币种

名称：指数计价币种

英文名称：IndexDenominatedCurrency

编号：C006

定义：指数计价的币种

数据类型：字符型

可枚举值域：美元 USD、欧元 EUR、日元 JPY、港元 HKD、英镑 GBP、人民币 CNY、其他

度量单位：无

6.3.1.7 加权方法

名称：加权方法

英文名称：WeightingType

编号：C007

定义：指数样本券权重计算的方法

数据类型：字符型

可枚举值域：市值加权、现金流法加权、等权重、托管量加权、其他

度量单位：无

6.3.1.8 指数市值

名称：指数市值

英文名称：MarketCap

编号：C008

定义：指数样本券市值之和

数据类型：数字型

度量单位：与指数计价币种配合使用

6.3.1.9 指数久期

名称：指数久期

英文名称：IndexDuration

编号：C009

定义：以某种加权方法计算的指数样本券组合久期

数据类型：数字型

度量单位：无

6.3.1.10 指数凸性

名称：指数凸性
 英文名称：IndexConvexity
 编号：C010
 定义：以某种加权方法计算的指数样本券组合凸性
 数据类型：数字型
 度量单位：无

6.3.1.11 指数到期收益率

名称：指数到期收益率
 英文名称：IndexYieldtoMaturity; IndexYTM
 编号：C011
 定义：以某种加权方法计算的指数样本券组合到期收益率
 数据类型：数字型
 度量单位：%

6.3.1.12 指数样本券数量

名称：指数样本券数量
 英文名称：NumberOfIndexConstituents
 编号：C012
 定义：指数的样本券数量合计
 数据类型：数字型
 度量单位：个

6.3.1.13 指数待偿期

名称：指数待偿期
 英文名称：IndexMaturity
 编号：C013
 定义：以某种加权方法计算的指数样本券组合待偿期
 数据类型：数字型
 度量单位：年

6.3.2 债券指数样本券信息要素

6.3.2.1 债券代码

名称：债券代码
 英文名称：BondCode
 编号：同 6.2.1 的编号
 定义：同 6.2.1 的定义
 数据类型：字符型
 度量单位：无

6.3.2.2 债券简称

名称：债券简称
 英文名称：BondShortName

编号：同 6.2.2 的编号
定义：同 6.2.2 的定义
数据类型：字符型
度量单位：无

6.3.2.3 指数样本券指标生效日期

名称：指数样本券指标生效日期
英文名称：EffectiveDateofIndexConstituentsIndicator
编号：C101
定义：按照 JR/T 0065—2019，即指数样本券指标在系统中可使用的日期，格式为 YYYY-MM-DD
数据类型：日期型
度量单位：无

6.3.2.4 流通场所

名称：流通场所
英文名称：Exchange
编号：同 6.2.4 的编号
定义：同 6.2.4 的定义
数据类型：字符型
可枚举值域：同 6.2.4 的可枚举值域
度量单位：无

6.3.2.5 指数样本券计价币种

名称：指数样本券计价币种
英文名称：DenominatedCurrencyofIndexConstituents
编号：C102
定义：指数样本券的计价币种
数据类型：字符型
可枚举值域：美元 USD、欧元 EUR、日元 JPY、港元 HKD、英镑 GBP、人民币 CNY、其他
度量单位：无

6.3.2.6 指数样本券价格

名称：指数样本券价格
英文名称：BondPriceofIndexConstituents
编号：C103
定义：指数样本券参与指数计算采用的价格
数据类型：数字型
度量单位：与指数样本券计价币种配合使用

6.3.2.7 指数样本券价格来源

名称：指数样本券价格来源
英文名称：PricingSource
编号：C104

定义：指数样本券参与指数计算采用的价格来源

数据类型：字符型

可枚举值域：双边报价中间价、银行间市场加权平均结算价、交易所市场收盘价、债券估值、其他
度量单位：无

6.3.2.8 指数样本券换券日

名称：指数样本券换券日

英文名称：IndexReconstitutionDate

编号：C105

定义：指数样本券调整的日期，格式为 YYYY-MM-DD

数据类型：日期型

度量单位：无

6.3.2.9 指数样本券分类

名称：指数样本券分类

英文名称：BondTypeofIndexConstituents

编号：C106

定义：指数样本券券种或概念分类

数据类型：字符型

度量单位：无

6.3.2.10 指数样本券选择权种类

名称：指数样本券选择权种类

英文名称：OptionTypeofIndexConstituents

编号：C107

定义：指数样本券发行条款中包含的选择权

数据类型：字符型

可枚举值域：发行人赎回选择权、投资人回售选择权、发行人调整票面利率选择权、其他

注：1. 发行人赎回选择权指发行人可在约定的日期，选择按照约定的价格将债券赎回的权利。

2. 投资人回售选择权指投资人可在约定的日期，选择按照约定的价格将债券回售给发行人的权利。

3. 发行人调整票面利率选择权指发行人可在约定的日期，选择调整债券票面利率的权利。

度量单位：无

6.3.2.11 指数样本券待偿期

名称：指数样本券待偿期

英文名称：MaturityofIndexConstituents

编号：C108

定义：指数样本券剩余期限，即指数样本券计算日至到期日之间的期限

数据类型：数字型

度量单位：日、月、年

6.3.2.12 指数样本券到期收益率

名称：指数样本券到期收益率

英文名称: YieldtoMaturityofIndexConstituents; YTMofIndexConstituents

编号: C109

定义: 指数样本券价格对应的持有到期的收益率

数据类型: 数字型

度量单位: %

6.3.2.13 指数样本券发行方式

名称: 指数样本券发行方式

英文名称: IssuanceTypeofIndexConstituents

编号: C110

定义: 指数样本券的募集设立方式

数据类型: 字符型

可枚举值域: 公开发行业、非公开发行业

注: 1. 公开发行业指指数样本券向不特定的投资者发行。

2. 非公开发行业指指数样本券仅针对特定的少数投资者发行。

度量单位: 无

6.3.2.14 指数样本券发行人全称

名称: 指数样本券发行人全称

英文名称: IssuerNameofIndexConstituents

编号: C111

定义: 按照 JR/T 0065—2019, 即指数样本券的发行人经过相关权威部门审核准许使用的具有法律效力的名称

数据类型: 字符型

度量单位: 无

6.3.2.15 指数样本券发行期限

名称: 指数样本券发行期限

英文名称: IssuanceTenorofIndexConstituents

编号: C112

定义: 指数样本券发行时起息日距离到期日的时间间隔

数据类型: 数字型

度量单位: 年

6.3.2.16 指数样本券发行人分类

名称: 指数样本券发行人分类

英文名称: IssuerTypeofIndexConstituents

编号: C113

定义: 指数样本券的发行人所属行业、概念分类、性质分类等

数据类型: 字符型

度量单位: 无

6.3.2.17 指数样本券发行量

名称：指数样本券发行量
 英文名称：IssuanceAmountofIndexConstituents
 编号：C114
 定义：指数样本券发行的面额
 数据类型：数字型
 度量单位：与指数样本券计价币种配合使用

6.3.2.18 指数样本券余额

名称：指数样本券余额
 英文名称：AmountOutstandingofIndexConstituents
 编号：C115
 定义：指数样本券的存量余额
 数据类型：数字型
 度量单位：与指数样本券计价币种配合使用

6.3.2.19 指数样本券计息类型

名称：指数样本券计息类型
 英文名称：CouponTypeofIndexConstituents
 编号：C116
 定义：按照 JR/T 0065—2019，即利息计算时使用的不同利息分类和付息方式分类
 数据类型：字符型

可枚举值域：贴现式、零息式、利随本清固定利率、利随本清浮动利率、付息式固定利率、付息式浮动利率

- 注：1. 贴现式指原始期限不超过一年（含）的债券，不附有息票，或是在票面上不规定利率，以低于面值的价格发行或出售转让，到期按照面值支付本息。
2. 零息式指原始期限超过一年的债券，不附有息票，或是在票面上不规定利率，以低于面值的价格发行或出售转让，到期按照面值支付本息。
3. 利随本清固定利率指债券存续期内不支付利息，利息和本金在债券到期时一次性偿还，附有固定利息。
4. 利随本清浮动利率指债券存续期内不支付利息，利息和本金在债券到期时一次性偿还，附有浮动利息。
5. 付息式固定利率指债券存续期内支付利息，附有固定利息。
6. 付息式浮动利率指债券存续期内支付利息，附有浮动利息。

度量单位：无

6.3.2.20 指数样本券应计利息

名称：指数样本券应计利息
 英文名称：AccruedInterestofIndexConstituents
 编号：C117

定义：付息期起始日到付息期指数生效日前一日的时段内累计增长的利息，即不包含指数生效日当日应计利息的累计利息

数据类型：数字型
 度量单位：与指数样本券计价币种配合使用

6.3.2.21 指数样本券票面利率

名称：指数样本券票面利率

英文名称：CouponRateofIndexConstituents

编号：C118

定义：指数样本券当前最新的票面利率

数据类型：数字型

度量单位：%

6.3.2.22 指数样本券权重

名称：指数样本券权重

英文名称：WeightofIndexConstituents

编号：C119

定义：指数样本券在指数中所占比重，包括但不限于全价市值权重、净价市值权重等

数据类型：数字型

度量单位：%

6.3.2.23 指数样本券市值

名称：指数样本券市值

英文名称：MarketCapofIndexConstituents

编号：C120

定义：指数样本券按照债券价格计算的总价值，包括但不限于全价市值、净价市值等

数据类型：数字型

度量单位：与指数样本券计价币种配合使用

6.3.2.24 指数样本券久期

名称：指数样本券久期

英文名称：DurationofIndexConstituents

编号：C121

定义：收益率变动 100 个基点时，指数样本券估价变动的近似百分比

数据类型：数字型

度量单位：无

6.3.2.25 指数样本券凸性

名称：指数样本券凸性

英文名称：ConvexityofIndexConstituents

编号：C122

定义：收益率变动 100 个基点时，指数样本券估价变化率变动的近似百分比

数据类型：数字型

度量单位：无

6.3.2.26 指数样本券债项评级

名称：指数样本券债项评级

英文名称：BondCreditRatingofIndexConstituents

编号：C123

定义：按照 JR/T 0065—2019，以企业或经济主体发行的有价债券或标的债务等为对象进行的信用评级

数据类型：字符型

度量单位：无

6.3.2.27 指数样本券主体评级

名称：指数样本券主体评级

英文名称：IssuerEntityRatingofIndexConstituents

编号：C124

定义：按照 JR/T 0065—2019，以企业、经济主体为对象进行的信用评级

数据类型：字符型

度量单位：无

6.4 债券风险价值类

6.4.1 债券代码

名称：债券代码

英文名称：BondCode

编号：同 6.2.1 的编号

定义：同 6.2.1 的定义

数据类型：字符型

度量单位：无

6.4.2 债券简称

名称：债券简称

英文名称：BondShortName

编号：同 6.2.2 的编号

定义：同 6.2.2 的定义

数据类型：字符型

度量单位：无

6.4.3 风险价值

名称：风险价值

英文名称：ValueatRisk; VaR

编号：D001

定义：债券或债券组合持有期内，在给定的概率水平下最大可能损失值

数据类型：数字型

度量单位：与债券计价币种配合使用

6.4.4 条件风险价值

名称：条件风险价值

英文名称：ConditionalValueatRisk; CVaR

编号：D002

定义：债券或债券组合在持有期内，超过某个给定 VaR 值之后的平均损失值

数据类型：数字型

度量单位：与债券计价币种配合使用

6.4.5 债券风险价值生效日期

名称：债券风险价值生效日期

英文名称：EffectiveDateofVaR

编号：D003

定义：按照 JR/T 0065—2019，即债券 VaR 在系统中可使用的日期，格式为 YYYY-MM-DD

数据类型：日期型

度量单位：无

6.4.6 流通场所

名称：流通场所

英文名称：Exchange

编号：同 6.2.4 的编号

定义：同 6.2.4 的定义

数据类型：字符型

可枚举值域：同 6.2.4 的可枚举值域

度量单位：无

6.4.7 持有期

名称：持有期

英文名称：HoldingPeriod

编号：D004

定义：计算 VaR 与 CVaR 时假定持有债券或债券组合的天数

数据类型：数字型

度量单位：天

6.4.8 置信水平

名称：置信水平

英文名称：ConfidenceLevel

编号：D005

定义：债券或债券组合在持有期内的损失小于或等于 VaR 的概率

数据类型：数字型

度量单位：%

参 考 文 献

- [1] GB/T 18391—2009 信息技术 元数据注册系统 (MDR)
-