

中证高等级短融美元指数编制方案

一、 指数名称

- 指数名称：中证高等级短融美元指数
- 英文名称：CSI Diversified High Grade Commercial Paper USD Index
- 指数简称：高等级短融美元
- 指数代码：H30397

二、 指数基日与基点

该指数基日为 2010 年 12 月 31 日，基点与中证高等级短融指数在上述基日的收盘点位相同。

三、 指数计算

在任一交易日 t，指数计算公式为：

$$\text{指数}_t = \text{中证高等级短融指数}_t \times \frac{\text{USD兑CNH即期汇率}_{t_0}}{\text{USD兑CNH即期汇率}_t}$$