

## 中证短融指数编制方案

该指数样本券由剩余年限 1 个月及以上且在银行间市场上市的短期融资券构成。指数采用市值加权计算，以反映全市场短期融资券的整体表现。

### 一、指数名称和代码

指数名称：中证短融指数  
指数简称：中证短融  
英文名称：CSI Short Term Note Index  
英文简称：CSI Short Term Note  
指数代码：H11014

### 二、指数基日和基点

该指数以 2007 年 01 月 31 日为基日，以 100 点为基点。

### 三、样本选取方法

中证短融指数的样本由满足以下条件的债券构成：

- (1) 债券种类：在银行间市场上市的企业短期融资券，债券币种为人民币；
- (2) 信用评级：投资级以上；
- (3) 债券剩余期限：1 个月及以上；
- (4) 付息方式：固定利率付息或一次还本付息。

### 四、指数计算

中证短融指数采用派许加权综合价格指数方法计算，公式为：

$$\text{报告期指数} = \frac{\text{报告期样本债券总市值} + \text{报告期债券派息及再投资}}{\text{除数}} \times 100$$

其中, 报告期样本债券总市值 =  $\Sigma(\text{全价} \times \text{发行量})$ , 全价=净价+应计利息。

该指数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。

## 五、样本调整

### 1、定期调整

中证短融指数样本每月调整一次, 定期调整生效日为每月首个交易日, 定期调整数据提取日为生效日前一个交易日。

### 2、临时调整

若样本券发生暂停上市、摘牌等事件, 自下一定期调样生效日起剔除出指数; 样本券发生其他事件, 参照计算与维护细则处理。