

## 中证短期国债指数编制方案

该指数样本券由剩余年限介于1至5年且在沪深交易所或银行间市场上市的国债构成。指数采用市值加权计算，以反映全市场相应期限国债的整体表现。

### 一、指数名称和代码

指数名称：中证短期国债指数

指数简称：短期国债

英文名称：CSI Short Term Treasury Note Index

英文简称：Short Term Treasury Note

指数代码：H11099

### 二、指数基日和基点

该指数以2007年12月31日为基日，以100点为基点。

### 三、样本选取方法

中证短期国债指数的样本由满足以下条件的债券构成：

(1) 债券种类：在沪深交易所或银行间债券市场上市的国债，债券币种为人民币；

(2) 债券剩余期限：1年以上，5年以下；

(3) 付息方式：固定利率付息或一次还本付息；

(4) 上市期限：小于3年。

### 四、指数计算

中证短期国债指数采用派许加权综合价格指数方法计算，计算公式为：

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

其中，报告期样本债券总市值=Σ（全价×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

中证短期国债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

满足条件的新发债券自上市次日起计入指数。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。