

中证高等级短融指数编制方案

中证高等级短融指数样本券由发行量 6 亿元及以上、主体信用级别为 AAA、或主体信用级别为 AA+且债项级别为 A-1 的短期融资券组成。指数采用市值加权计算，以反映高等级短期融资券的整体表现。

一、指数名称和代码

指数名称：中证高等级短融指数

指数简称：高等级短融

英文名称：CSI Diversified High Grade Commercial Paper Index

英文简称：High Grade CP Index

指数代码：H30396

二、指数基日和基点

中证高等级短融指数以 2007 年 12 月 31 日为基日，以 100 点为基点。

三、样本选取方法

中证高等级短融指数的样本由满足以下条件的债券构成：

- (1) 债券种类：在银行间债券市场上市的短期融资券，债券币种为人民币；
- (2) 信用评级：短期融资券的发行主体信用级别为 AAA 级，或者主体信用级别为 AA+，且债项级别为 A-1 投资级以上；
- (3) 债券余额：6 亿元及以上；
- (4) 债券剩余期限：1 个月及以上；
- (5) 付息方式：固定利率付息或一次还本付息。

四、指数计算

中证高等级短融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

中证高等级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第二个交易日。

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。