

# 国证货币基金指数编制方案

(2015年8月)

为综合反映国内货币基金市场总体变动趋势，满足投资者对货币基金业绩评价及投资参考的需求，编制国证货币基金指数。指数通过国证指数网发布收盘行情数据。

## 一、 指数代码与名称

指数代码：CN6112

指数简称：货基指数

指数中文全称：国证货币基金指数

指数英文名称：CNI MONEY FUND INDEX

## 二、 基日与基点

指数以2003年12月31日为基日，基日点位为1000点。

## 三、 样本选择方法

指数样本由中国大陆证券市场所有开放式货币型基金组成。

## 四、 指数计算方法

采用简单平均法，依据下列公式逐日连锁计算：

$$I_t = I_{t_0} \times \left(1 + \frac{1}{N_t} \sum_{i=1}^{N_t} r_{i,t}\right)$$

$I_t$ : 当期指数点位。

$I_{t_0}$ : 上一期指数点位。

$N_t$ : 当期指数样本数。

$r_{i,t}$ : 当期第  $i$  只样本基金收益率，基金收益率以基金公布的当日基金收益为准。

## 五、 样本调整

1. 新基金发行：新基金连续公布单位净值的次日纳入货币基金指数；
2. 基金终止：在基金终止日剔除基金样本；
3. 基金合并与分拆：根据基金公告信息进行即时调整。

## 六、 指数的发布与管理

### 1. 指数的发布

国证货币基金指数通过国证指数网发布收盘行情数据，指数样本信息通过国证指数网（[www.cnindex.com.cn](http://www.cnindex.com.cn)）发布。

### 2. 指数的管理

国证货币基金指数由深圳证券信息有限公司负责设计与管理，指数属于深圳证券信息有限公司资产，未经深圳证券信息公司书面许可，任何单位或个人不得跟踪、交易该指数，或以该指数为评价基准。

## 七、 免责声明

本文件和其中的所有信息，包括但不限于所有的文字、数据、图

表、表格属于深圳证券信息有限公司的财产，受中国知识产权法律及相关法律保护。未经深圳证券信息有限公司书面许可，不得将这些信息全部或部分复制或再次传播。

本文件及其中任何信息均不构成任何证券、金融产品或其他投资工具或任何交易策略的依据或建议，也不表示深圳证券信息有限公司及其关联方关于任何发行人、证券、金融产品或工具或交易策略的意见。

对任何直接或间接使用本文件及其任何信息而造成的损失，包括但不限于因内容不准确、不完整而导致的损失，深圳证券信息公司及其关联方无须承担任何法律责任。