上证 3-5 年期中高等级可质押信用债指数编制方案

上证 3-5 年期中高等级可质押信用债指数样本券由在上海证券交易所市场挂牌的剩余期限 3 年以上、5 年及以下的可质押公司债和企业债组成。指数采用市值加权计算。

一、指数名称和代码

指数名称：上证 3-5 年期中高等级可质押信用债指数

指数简称：沪质中高债 3-5

英文名称：SSE 3-5 Year Collateralizable Medium-High Grade Credit Bond Index

英文简称：SSE Collateralizable MHG Credit Bond 3-5

指数代码：950113

二、指数基日和基点

该指数以 2008 年 12 月 31 日为基日，以 100 点为基点。

三、样本选取方法

1、样本空间

上证 3-5 年期中高等级可质押信用债指数的样本空间由满足以下条件的债券构成：

（1）债券种类：在上海证券交易所市场挂牌公司债和企业债，且符合中国证券登记结算公司对可质押债券的要求，债券币种为人民币。

（2）信用评级：企业债债项评级 AAA，主体评级 AA+及以上；公司债债项评级和主体评级 AA+及以上；且评级展望为正面或稳定。

（3）债券剩余期限：3 年以上，5 年及以下。

（4）付息方式：固定利率付息或累进利率付息。

2、选样方法

选取样本空间内所有债券作为指数样本券。

四、指数计算

上证3-5年期中高等级可质押信用债指数采用派许加权综合价格指数方法计算，计算公式为：

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

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

上证 3-5 年期中高等级可质押信用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，视情况自事件生效之日起剔除出指数；样本券发生其他事件，参照计算与维护细则处理。