上证绿色债券 AAA 指数编制方案

上证绿色债券 AAA 指数样本券由在上海证券交易所上市交易的信用评级为 AAA、剩余期限为 1 个月以上的绿色债券构成，不包括 ABS、私募及股债关联品种。指数采用市值加权计算，以反映沪市相应级别绿色债券的整体表现。

一、指数名称和代码

指数名称：上证绿色债券 AAA 指数

指数简称：上证绿色债 AAA

英文名称：SSE Green Bond AAA Index

英文简称：SSE Green Bond AAA

指数代码：950183

二、指数基日和基点

该指数以 2016 年 12 月 30 为基日，以 100 点为基点。

三、样本选取方法

1、样本空间

上证绿色债券 AAA 指数的样本空间由满足以下条件的债券构成:

（1） 债券种类：在上海证券交易所上市交易的绿色债券，不包括 ABS、私募和股债关联品种，债券币种为人民币;

（2） 信用评级：债项评级 AAA;

（3） 债券剩余期限：1 个月以上;

（4） 付息方式：固定利率付息或一次还本付息。

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

上证绿色债券 AAA 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

上证绿色债券 AAA 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，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。