

## 上证长三角信用债指数编制方案

上证长三角信用债指数从上海证券交易所上市的信用债中，选取发行人所在地为长三角区域的债券作为指数样本，以反映上交所长三角区域信用债的整体表现。

### 一、指数名称和代码

指数名称：上证长三角信用债指数

指数简称：上证长三角信用债

英文名称：SSE Yangtze River Delta Area Credit Bond Index

英文简称：SSE Delta Area Credit Bond

指数代码：950190

### 二、指数基日和基点

该指数以 2014 年 12 月 31 日为基日，以 100 点为基点。

### 三、样本选取方法

上证长三角信用债指数的样本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的公司债、企业债，不包括私募品种，债券币种为人民币；

(2) 债项评级：AA 及以上；

(3) 剩余期限：1 年及以上；

(4) 发行人所在地：上海市、浙江省、江苏省或安徽省；

(5) 付息方式：固定利率付息或一次还本付息。

#### 四、指数计算

上证长三角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：

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

其中，报告期样本债券总市值 =  $\sum(\text{全价} \times \text{发行量})$ ，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、指数样本和权重调整

##### 1、定期调整

上证长三角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一交易日。

##### 2、临时调整

若样本发生摘牌等事件，视情况自事件生效之日起剔除出指数；样本发生其他事件，参照计算与维护细则处理。