

上证证券公司债指数系列编制方案

上证证券公司债指数系列从上海证券交易所上市的、由证券公司所发行的债券中,分别选取相应剩余期限、信用评级的债券作为指数样本,以反映相应证券公司债的整体表现。

一、指数名称和代码

指数名称	指数简称	英文名称	英文简称	指数代码
上证证券公司债 指数	上证证券公司债	SSE Securities Company Bond Index	SSE Securities Company Bond	950197
上证证券公司债 AAA 指数	上证证券公司债 AAA	SSE Securities Company Bond AAA Index	SSE Securities Company Bond AAA	950198
上证证券公司债 高等级指数	上证证券公司债高等级	SSE Securities Company Bond High Grade Index	SSE Securities Company Bond High Grade	950199
上证证券公司债 0-3 年 AAA 指数	上证证券公 司债 0-3AAA	SSE Securities Company Bond 0-3Y AAA Index	SSE Securities Company Bond 0-3 AAA	950200
上证证券公司债 0-3 年高等级指数	上证证券公司债 0-3 高等级	SSE Securities Company Bond 0-3Y High Grade Index	SSE Securities Company Bond 0-3 High Grade	950201

二、指数基日和基点

该指数系列以2016年12月30日为基日,以100点为基点。

三、样本选取方法

1、样本空间

上证证券公司债指数系列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的证券公司债等债券品种,不包括 私募品种,债券币种为人民币;
 - (2) 付息方式: 固定利率付息或一次还本付息。

2、选样方法

选取样本空间中剩余期限和信用评级符合如下条件的债券作为各指数的样本:

指数代码	指数简称	剩余期限	信用评级
950197	上证证券公司债	1年以上	
950198	上证证券公司债	1年以上	信用评级 AAA,
	AAA	1 干以工	中证隐含评级 AA+以上
950199	上证证券公司债高	1年以上	信用评级 AA+及以上,
	等级	1 干以工	中证隐含评级 AA+及以上
950200	上证证券公司债	3年及以下	信用评级 AAA,
	0-3AAA	3 千及以下	中证隐含评级 AA+以上
950201	上证证券公司债 3年及以下		信用评级 AA+及以上,
	0-3 高等级	3 千灰以下	中证隐含评级 AA+及以上

四、指数计算

上证证券公司债指数系列采用派许加权综合价格指数方法计算,计算公式为:

其中,报告期样本债券总市值=∑(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、指数样本和权重调整

1、定期调整

上证证券公司债指数系列样本每月调整一次,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。