

上证央企信用债指数系列编制方案

上证央企信用债指数系列从上海证券交易所上市的中央企业债券中,选取剩余期限符合条件的公司债、企业债作为指数样本,以反映上海证券交易所上市的相应央企信用债的整体表现。

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
上证央企信用债指数	上证央企债	SSE Central State-owned Enterprises Credit Bond Index	SSE Central SOEs Bond	950240
上证 0-3 年央企信用债指数	上证 0-3 年央企债	SSE 0-3 Year Central State-owned Enterprises Credit Bond Index	SSE 0-3 Year Central SOEs Bond	950241
上证 0-5 年央企信用债指数	上证 0-5 年央企债	SSE 0-5 Year Central State-owned Enterprises Credit Bond Index	SSE 0-5 Year Central SOEs Bond	950242

二、指数基日和基点

该指数系列以 2013 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

上证央企信用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公司债、企业债,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

(1) 根据国务院国有资产监督管理委员会的央企名录确定央企发行人；

(2) 根据上述发行人，选取样本空间中剩余期限符合如下条件的债券作为各指数样本券：

指数代码	指数简称	剩余期限
950240	上证央企债	无
950241	上证 0-3 年央企债	3 年及以下
950242	上证 0-5 年央企债	5 年及以下

四、指数计算

上证央企信用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：

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

其中，报告期样本债券总市值= $\sum[(\text{净价} + \text{应计利息}) \times \text{发行量} \times \text{权重因子}]$

当发行人数量不足 10 时，权重因子为 1；当发行人数量不少于 10 时，权重因子介于 0 和 1 之间，以使单一发行人权重不超过 10%。

该指数系列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

上证央企信用债指数系列每季度调整一次，定期调整生效日分别为每年 1 月、4 月、7 月和 10 月份的首个交易日。

权重因子随样本定期调整而调整，调整时间与指数样本定期调整实施时间相

同。在下一个定期调整日前，权重因子一般固定不变。

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。