

## 上证信用债指数编制方案

上证信用债指数从上海证券交易所上市的信用债中选取符合条件的债券作为指数样本，以反映相应信用债的整体表现。

### 一、指数名称和代码

指数名称：上证信用债指数

指数简称：上证信用

英文名称：SSE Credit Bond Index

英文简称：SSE Credit Bond

指数代码：950257

### 二、指数基日和基点

该指数以 2007 年 12 月 31 日为基日，以 100 点为基点。

### 三、样本选取方法

上证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：在上海证券交易所上市交易的企业债、公司债等信用债品种，不含私募债，债券币种为人民币；
- (2) 信用级别：AA 及以上；
- (3) 付息方式：固定利率付息或一次还本付息。

### 四、指数计算

上证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=  $\sum[(\text{净价} + \text{应计利息}) \times \text{发行量}]$ 。

该指数计算用价格为中证估值价格，其他计算用数据、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，定期调整数据截止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。