

## 上证国企信用债指数系列编制方案

上证国企信用债指数系列从上海证券交易所上市的公司债和企业债中，选取由国有企业发行的符合条件的债券作为指数样本，以反映相应国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
上证国企信用债指数	上证国企债	SSE State-owned Enterprises Credit Bond Index	SSE SOEs Bond	950246
上证0-3年国企信用债指数	上证0-3国企债	SSE 0-3 Year State-owned Enterprises Credit Bond Index	SSE 0-3 SOEs Bond	950247
上证0-5年国企信用债指数	上证0-5国企债	SSE 0-5 Year State-owned Enterprises Credit Bond Index	SSE 0-5 SOEs Bond	950248
上证AAA国企信用债指数	上证AAA国企债	SSE AAA State-owned Enterprises Credit Bond Index	SSE AAA SOEs Bond	950249
上证短期AAA国企信用债指数	上证短期AAA国企债	SSE Short Term AAA State-owned Enterprises Credit Bond Index	SSE Short Term AAA SOEs Bond	950250
上证0-3年AAA国企信用债指数	上证0-3AAA国企债	SSE 0-3 Year AAA State-owned Enterprises Credit Bond Index	SSE 0-3 AAA SOEs Bond	950251
上证0-5年AAA国企信用债指数	上证0-5AAA国企债	SSE 0-5 Year AAA State-owned Enterprises Credit Bond Index	SSE 0-5 AAA SOEs Bond	950252

### 二、指数基日和基点

指数代码	指数简称	基日	基点
------	------	----	----

950246	上证国企债	2013/12/31	100
950247	上证 0-3 国企债	2013/12/31	100
950248	上证 0-5 国企债	2013/12/31	100
950249	上证 AAA 国企债	2016/12/30	100
950250	上证短期 AAA 国企债	2016/12/30	100
950251	上证 0-3 AAA 国企债	2016/12/30	100
950252	上证 0-5 AAA 国企债	2016/12/30	100

### 三、样本选取方法

#### 1、样本空间

上证国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和企业债，不包括私募品种，债券币种为人民币；

(2) 发行人企业属性：中央国有企业和地方国有企业；

(3) 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样本：

指数代码	指数简称	剩余期限	信用评级
950246	上证国企债	无	主体评级 AA 及以上
950247	上证 0-3 国企债	3 年及以下	主体评级 AA 及以上
950248	上证 0-5 国企债	5 年及以下	主体评级 AA 及以上
950249	上证 AAA 国企债	无	主体评级 AAA，中证隐含评级 AA+ 以上
950250	上证短期 AAA 国企债	397 天及以下	主体评级 AAA，中证隐含评级 AA+ 以上
950251	上证 0-3 AAA 国企债	3 年及以下	主体评级 AAA，中证隐含评级 AA+ 以上
950252	上证 0-5 AAA 国企债	5 年及以下	主体评级 AAA，中证隐含评级 AA+ 以上

## 四、指数计算

上证国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、样本调整

### 1、定期调整

上证国企信用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。