

上证基准做市债券指数系列编制方案

上证基准做市债券指数系列从上海证券交易所上市的债券中，分别选取符合上交所基准做市品种规则的债券作为指数样本，以反映上海证券交易所流动性较好债券的整体表现。

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
上证基准做市国债指数	沪做市国债	SSE Market-Making Treasury Bond Index	SSE Market-Making Treasury	950243
上证基准做市公司债指数	沪做市公司债	SSE Market-Making Corporate Bond Index	SSE Market-Making Corporate Bond	950245

二、指数基日和基点

该指数系列以 2022 年 6 月 30 日为基日，以 100 点为基点。

三、样本选取方法

1、样本空间

上证基准做市债券指数系列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国债及公司债等，不含私募品种，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；

(3) 发行规模：国债 20 亿及以上，公司债 30 亿及以上。

2、选样方法

在样本空间内，选取满足下列条件且在上海证券交易所基准做市品种名单范围内全部的债券作为指数样本。

指数代码	指数简称	债券种类	选样条件
950243	沪做市国债	国债	从1年期、2年期、3年期、5年期、10年期等期限的国债中分别选取最新上市的两只债券
950245	沪做市公司债	公司债	信用评级为AAA

四、指数计算

上证基准做市债券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：

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

$$\text{其中，报告期样本总市值} = \sum[(\text{净价} + \text{应计利息}) \times \text{发行量}]$$

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

上证基准做市债券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。