

## 上证科技创新公司债指数系列编制方案

上证科技创新公司债指数系列从上海证券交易所上市的科技创新公司债中，选取剩余期限、信用评级符合条件的债券作为指数样本，以反映相应上交所科技创新公司债的整体表现。

### 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
上证科技创新公司债指数	沪科创债	SSE Sci-Tech Innovation Corporate Bond Index	SSE Sci-Tech Bond	950165
上证高等级科技创新公司债指数	沪高等级科创债	SSE High Grade Sci-Tech Innovation Corporate Bond Index	SSE High Grade Sci-Tech Bond	950166
上证 AAA 科技创新公司债指数	沪 AAA 科创债	SSE AAA Sci-Tech Innovation Corporate Bond Index	SSE AAA Sci-Tech Bond	950167
上证 0-3 年 AAA 科技创新公司债指数	沪 0-3 AAA 科创债	SSE 0-3 Year AAA Sci-Tech Innovation Corporate Bond Index	SSE 0-3 AAA Sci-Tech Bond	950168
上证 0-5 年 AAA 科技创新公司债指数	沪 0-5 AAA 科创债	SSE 0-5 Year AAA Sci-Tech Innovation Corporate Bond Index	SSE 0-5 AAA Sci-Tech Bond	950169
上证 AAA 国企科技创新公司债指数	沪 AAA 国企科创债	SSE AAA SOE Sci-Tech Innovation Corporate Bond Index	SSE AAA SOE Sci-Tech Bond	950170
上证 0-3 年 AAA 国企科技创新公司债指数	沪 0-3 AAA 国企科创债	SSE 0-3Year AAA SOE Sci-Tech Innovation Corporate Bond Index	SSE AAA 0-3 SOE Sci-Tech Bond	950171
上证 0-5 年 AAA 国企科技创新公司债指数	沪 0-5 AAA 国企科创债	SSE 0-5 Year AAA SOE Sci-Tech Innovation Corporate Bond Index	SSE AAA 0-5 SOE Sci-Tech Bond	950172

## 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

上证科技创新公司债指数系列的样本由满足以下条件的债券构成：

(1) 在上海证券交易所上市的科技创新公司债，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。

### 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	发行人企业属性	剩余期限	信用评级
950165	沪科创债	无	无	主体评级 AA 及以上，隐含评级 AA 及以上
950166	沪高等级科创债		无	主体评级 AA+ 及以上，隐含评级 AA+ 及以上
950167	沪 AAA 科创债		无	主体评级 AAA，隐含评级 AA+ 及以上
950168	沪 AAA 0-3 科创债		3 年及以下	主体评级 AA+ 及以上
950169	沪 AAA 0-5 科创债		5 年及以下	
950170	沪 AAA 国企科创债		中央国有企业及地方国有企业	无
950171	沪 0-3 AAA 国企科创债	3 年及以下		
950172	沪 0-5 AAA 国企科创债	5 年及以下		

## 四、指数计算

上证科技创新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：

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

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

上证科技创新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，定期调整数据截止日为生效日前一交易日。

### 2、临时调整

满足条件的新发债券自上市次日起进入指数。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。