

上证长三角高等级绿色债券指数编制方案

上证长三角高等级绿色债券指数从上海证券交易所上市债券中选取注册地为长三角的发行人所发行的信用评级 AA+及以上的绿色债券作为指数样本，以反映长三角高等级绿色债券的整体表现。

一、指数名称和代码

指数名称：上证长三角高等级绿色债券指数

指数简称：沪长三角高等级绿债

英文名称：SSE Yangtze River Delta High Grade Green Bond Index

英文简称：SSE Yangtze River Delta High Grade Green Bond

指数代码：950122

二、指数基日和基点

该指数系列以 2017 年 12 月 29 日为基日，以 100 点为基点。

三、样本选取方法

1、样本空间

上证长三角高等级绿色债券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的企业债、公司债等债券品种，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) 信用评级：信用评级 AA+及以上，中证隐含评级 AA-以上。

2、选样方法

在样本空间内，选取注册地为上海市、江苏省、浙江省、安徽省的发行人所发行的绿色债券作为指数样本。

四、指数计算

上证长三角高等级绿色债券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

上证长三角高等级绿色债券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。