

## 上证分区域信用债指数系列编制方案

上证分区域信用债指数系列覆盖多个区域，以反映上海证券交易所上市的相应区域信用债的整体表现。

### 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
上证长江经济带信用债指数	上证长江信用债	SSE Yangtze River Economic Belt Credit Bond Index	SSE Yangtze River Credit Bond	950235
上证黄河流域信用债指数	上证黄河信用债	SSE Yellow River Basin Credit Bond Index	SSE Yellow River Basin Credit Bond	950236
上证京津冀信用债指数	上证京津冀信用债	SSE Beijing-Tianjin-Hebei Credit Bond Index	SSE Jing-Jin-Ji Credit Bond	950237

### 二、指数基日和基点

该指数以 2014 年 12 月 31 日为基日，以 100 点为基点。

### 三、样本选取方法

#### 1、样本空间

上证分区域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的公司债、企业债，不包括私募品种，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

选取样本空间中发行人所在地、剩余期限和信用评级符合如下条件的债券作为各指数的样本券：

指数代码	指数简称	发行人所在地	剩余期限	信用评级
950235	上证长江信用债	上海市、江苏省、浙江省、安徽省、江西省、湖北省、湖南省、重庆市、四川省、云南省、贵州省	1年以上	债项评级AA及以上
950236	上证黄河信用债	青海省、四川省、甘肃省、宁夏回族自治区、内蒙古自治区、山西省、陕西省、河南省、山东省		
950237	上证京津冀信用债	北京市、天津市、河北省		

## 四、指数计算

上证分区域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 =  $\sum(\text{全价} \times \text{发行量} \times \text{权重因子})$ ，全价 = 净价 + 应计利息。

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、指数样本和权重调整

### 1、定期调整

上证分区域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。