

上证民企公司债指数编制方案

上证民企公司债指数样本券由在上海证券交易所上市、由民营企业发行且信用评级在 AA 及以上的公司债组成，反映沪市民企公司债的市场表现。

一、指数名称和代码

指数名称：上证民企公司债指数

指数简称：上证民企公司债

英文名称：SSE Private-owned Enterprises Corporate Bond Index

英文简称：SSE POEs Corporate Bond

指数代码：950108

二、指数基日和基点

该指数以 2011 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

上证民企公司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，债券币种为人民币；
- （2）信用评级：债项评级 AA 及以上，且中证估值隐含评级 A 以上；
- （3）剩余期限：一个月以上；
- （4）付息方式：固定利率付息或一次还本付息。

2、选样方法

在样本空间中，根据发行人股权结构和实际控制人属性，选取发行人为民营企业债券作为指数样本券。

四、指数计算

上证民企公司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= $\sum$ （全价×发行量），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、样本调整

1、定期调整

上证民企公司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第二个交易日。

2、临时调整

若样本券发生暂停上市、摘牌等事件，视情况自事件生效之日起剔除出指数；样本券发生其他事件，参照计算与维护细则处理。