

上证短期高等级信用债指数编制方案

上证短期高等级信用债指数从上海证券交易所上市的信用债中，选取剩余期限在 397 天及以下、主体评级 AA+及以上、隐含评级 AA+及以上的信用债作为指数样本，以反映相应信用债的整体表现。

一、指数名称和代码

指数名称：上证短期高等级信用债指数

指数简称：沪短期高等级信用债

英文名称：SSE Short Term High Grade Credit Bond Index

英文简称：SSE Short Term High Grade Credit Bond

指数代码：950112

二、指数基日和基点

该指数以 2016 年 12 月 30 日为基日，以 100 点为基点。

三、样本选取方法

1、样本空间

上证短期高等级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交易的企业债、公司债等信用债品种，不含私募债，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

在样本空间中，选取剩余期限 397 天及以下、主体评级为 AA+及以上、隐

含评级为 AA+及以上的债券作为指数样本。

四、指数计算

上证短期高等级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 = $\sum[(\text{净价} + \text{应计利息}) \times \text{发行量}]$ 。

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

上证短期高等级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。