

## 上证分行业信用债指数系列编制方案

上证分行业信用债指数系列从上海证券交易所上市的信用债中，选取各行业  
内信用评级符合条件的债券作为指数样本，以反映相应行业信用债的整体表现。

### 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
上证能源信用债指数	沪能源信用债	SSE Energy Credit Bond Index	SSE Energy Credit Bond	950272
上证原材料信用债指数	沪原材料信用债	SSE Materials Credit Bond Index	SSE Materials Credit Bond	950273
上证工业信用债指数	沪工业信用债	SSE Industrials Credit Bond Index	SSE Industrials Credit Bond	950275
上证可选消费信用债指数	沪可选消费信用债	SSE Consumer Discretionary Credit Bond Index	SSE Consumer Discretionary Credit Bond	950276
上证主要消费信用债指数	沪主要消费信用债	SSE Consumer Staples Credit Bond Index	SSE Consumer Staples Credit Bond	950277
上证医药卫生信用债指数	沪医药卫生信用债	SSE Health Care Credit Bond Index	SSE Health Care Credit Bond	950278
上证信息技术信用债指数	沪信息技术信用债	SSE Information Technology Credit Bond Index	SSE Information Technology Credit Bond	950279
上证通信服务信用债指数	沪通信服务信用债	SSE Communication Services Credit Bond Index	SSE Communication Services Credit Bond	950280
上证公用事业信用债指数	沪公用事业信用债	SSE Utilities Credit Bond Index	SSE Utilities Credit Bond	950281
上证房地产信用债指数	沪房地产信用债	SSE Real Estate Credit Bond Index	SSE Real Estate Credit Bond	950282

### 二、指数基日和基点

该指数系列以 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

上证分行业信用债指数系列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和企业债，不含私募品种和城投债，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

选取样本空间中信用评级和中证一级行业符合如下条件的债券作为各指数样本：

指数代码	指数简称	信用评级	中证一级行业
950272	沪能源信用债	主体评级 AA 及以上， 隐含评级 AA-以上	能源
950273	沪原材料信用债		原材料
950275	沪工业信用债		工业
950276	沪可选消费信用债		可选消费
950277	沪主要消费信用债		主要消费
950278	沪医药卫生信用债		医药卫生
950279	沪信息技术信用债		信息技术
950280	沪通信服务信用债		通信服务
950281	沪公用事业信用债		公用事业
950282	沪房地产信用债		房地产

### 四、指数计算

上证分行业信用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

上证分行业信用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

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。