

上证国企绿色债券指数系列编制方案

上证国企绿色债券指数系列从上海证券交易所上市的绿色债券中，分别选取由国有企业发行的相应信用评级的债券作为指数样本，以反映上海证券交易所市场相应信用等级国企绿色债券的整体表现。

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
上证国企绿色债券指数	上证国企绿债	SSE State-owned Enterprises Green Bond Index	SSE SOEs Green Bond	950368
上证 AAA 国企绿色债券指数	上证 AAA 国企绿债	SSE AAA State-owned Enterprises Green Bond Index	SSE AAA SOEs Green Bond	950369
上证高等级国企绿色债券指数	上证高等级国企绿债	SSE High Grade State-owned Enterprises Green Bond Index	SSE High Grade SOEs Green Bond	950370

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

该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交易的绿色债券，不含 ABS、私募债和股债关联品种，债券币种为人民币；

（2）发行人企业属性：中央国有企业和地方国有企业；

(3) 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，选取信用评级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
950368	上证国企绿债	信用评级 AA 及以上，中证隐含评级 A 及以上
950369	上证 AAA 国企绿债	信用评级 AAA，中证隐含评级 AA+及以上
950370	上证高等级国企绿债	信用评级 AA+及以上，中证隐含评级 AA 及以上

四、指数计算

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 = $\sum[(\text{净价} + \text{应计利息}) \times \text{发行量}]$ 。

该指数系列计算用价格为中证估值价格，其他计算用数据和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

该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，数据截止日为月末倒数第二个交易日。

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。