

## 上证高成长产业债指数系列编制方案

上证高成长产业债指数系列从上海证券交易所市场上市的债券中，选取剩余期限、信用评级符合条件的高成长产业债作为指数样本，以反映上海证券交易所市场相应高成长产业债的整体表现。

### 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
上证高成长产业债指数	沪高成长产业债	SSE High-Growth Industrial Bond Index	High-Growth Industrial	950371
上证中高等级高成长产业债指数	沪中高等级高成长产业债	SSE Mid-High Grade High-Growth Industrial Bond Index	Mid-High Grade High-Growth Industrial	950372
上证 AAA 高成长产业债指数	沪 AAA 高成长产业债	SSE AAA High-Growth Industrial Bond Index	AAA High-Growth Industrial	950373

### 二、指数基日和基点

该指数系列以 2024 年 6 月 28 日为基日，以 100 点为基点。

### 三、样本选取方法

#### 1、样本空间

指数系列的样本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高成长产业债，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

在样本空间内，选取符合条件的债券作为指数样本。

指数代码	指数简称	发行方式	信用评级
950371	沪高成长产业债	无限制	主体评级 AA 及以上
950372	沪中高等级高成长产业债	公募	主体评级 AA 及以上
950373	沪 AAA 高成长产业债	公募	主体评级 AAA

#### 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

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。

##### 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。