

上证增信产业债指数系列编制方案

上证增信产业债指数系列从上海证券交易所上市的公司债和企业债中，选取相应期限、评级且具有担保增信的产业债作为指数样本，以反映上海证券交易所增信产业债的整体表现。

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
上证高等级担保机构增信产业债指数	沪高等级担保机构增信产业债	SSE High Grade Guarantee Institution Credit Enhancement Industrial Bond Index	SSE H-Grade Guarantee Institution Enhance Industrial Bond	950285
上证高等级增信产业债指数	沪高等级增信产业债	SSE High Grade Credit Enhancement Industrial Bond Index	SSE High Grade Credit Enhancement Industrial Bond	950286
上证 0-3 年高等级增信产业债指数	沪 0-3 高等级增信产业债	SSE 0-3 Year High Grade Credit Enhancement Industrial Bond Index	SSE 0-3Y High Grade Credit Enhancement Industrial Bond	950287
上证 0-5 年高等级增信产业债指数	沪 0-5 高等级增信产业债	SSE 0-5 Year High Grade Credit Enhancement Industrial Bond Index	SSE 0-5Y High Grade Credit Enhancement Industrial Bond	950288
上证 AAA 增信产业债指数	沪 AAA 增信产业债	SSE AAA Credit Enhancement Industrial Bond Index	SSE AAA Credit Enhancement Industrial Bond	950289
上证 0-3 年 AAA 增信产业债指数	沪 0-3 AAA 增信产业债	SSE 0-3 Year AAA Credit Enhancement Industrial Bond Index	SSE 0-3Y AAA Credit Enhancement Industrial Bond	950290
上证 0-5 年 AAA 增信产业债指数	沪 0-5 AAA 增信产业债	SSE 0-5 Year AAA Credit Enhancement Industrial Bond Index	SSE 0-5Y AAA Credit Enhancement Industrial Bond	950291

二、指数基日和基点

该指数系列以 2017 年 12 月 29 日为基日，以 100 点为基点。

三、样本选取方法

1、样本空间

上证增信产业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及企业债等，不含私募品种、城投债、政府支持机构债券、金融行业及房地产行业发行人所发行的债券，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，选取符合如下条件且具有担保增信的债券作为各指数样本：

指数代码	指数简称	担保机构类型	剩余期限	债项评级
950285	沪高等级担保机构增信产业债	融资担保类公司和信用增进类公司等	无限制	AA+及以上
950286	沪高等级增信产业债	无限制	无限制	AA+及以上
950287	沪 0-3 高等级增信产业债		3 年及以下	
950288	沪 0-5 高等级增信产业债		5 年及以下	
950289	沪 AAA 增信产业债		无限制	AAA
950290	沪 0-3AAA 增信产业债		3 年及以下	
950291	沪 0-5AAA 增信产业债		5 年及以下	

四、指数计算

上证增信产业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

上证增信产业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。