

## 上证 180 债券指数系列编制方案

上证 180 债券指数系列从上海证券交易所上市的债券中，选取上证 180 指数样本证券发行人及其子公司所发行的对应期限及信用等级的债券作为指数样本，以反映上证 180 指数样本证券发行人及其子公司所发行的对应期限及信用等级债券的整体表现。

### 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 180 债券指数	上证 180 债券	SSE 180 Bond Index	SSE 180 Bond	950340
上证 180AAA 债券指数	上证 180AAA 债券	SSE 180 AAA Bond Index	SSE 180 AAA Bond	950341
上证 180 AAA0-3 年债券指数	上证 180AAA0-3 债券	SSE 180 AAA 0-3 Year Bond Index	SSE 180 AAA 0-3 Bond	950342
上证 180 AAA0-5 年债券指数	上证 180AAA0-5 债券	SSE 180 AAA 0-5 Year Bond Index	SSE 180 AAA 0-5 Bond	950343

### 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

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的公司债、企业债、金融债等债券品种，不含私募债和永续债，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，选取上证 180 指数样本证券发行人及其子公司所发行的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	剩余期限
950340	上证 180 债券	信用评级 AA 及以上， 中证隐含评级 A+以上	无限制
950341	上证 180AAA 债券	信用评级 AAA，中证隐 含评级 AA+及以上	无限制
950342	上证 180AAA0-3 债券		3 年及以下
950343	上证 180AAA0-5 债券		5 年及以下

## 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

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。

### 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。