

上证周期产业债指数编制方案

上证周期产业债指数样本券由在上海证券交易所上市的公司债和企业债中发行主体为能源、材料、工业、公用事业、信息技术或可选消费行业的债券组成。指数采用市值加权计算，以反映沪市周期产业债的整体表现。

一、指数名称和代码

指数名称：上证周期产业债指数
指数简称：上证周期债
英文名称：SSE Cycle Industry Bond Index
英文简称：SSE Cycle Bond
指数代码：950102

二、指数基日和基点

该指数以 2007 年 12 月 31 日为基日，以 100 点为基点。

三、样本选取方法

上证周期产业债指数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公司债和企业债，债券币种为人民币；
- (2) 债券剩余期限：1 个月以上；
- (3) 付息方式：固定利率付息、或浮动利率付息、或一次还本付息；
- (4) 发行主体行业分类：能源、材料、工业、公用事业、信息技术或可选消费行业。

四、指数计算

上证周期产业债指数采用派许加权综合价格指数方法计算，计算公式为：

$$\text{报告期指数} = \frac{\text{报告期样本债券总市值} + \text{报告期样本券派息}}{\text{除数}} \times 100$$

其中，报告期样本债券总市值 = Σ (全价 \times 发行量)，全价=净价+应计利息。

该指数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

上证周期产业债指数样本每月调整一次，定期调整生效日为每月首个交易日，定期调整数据提取日为生效日前第二个交易日。

2、临时调整

若样本券发生暂停上市、摘牌等事件，自下一定期调样生效日起剔除出指数；样本券发生其他事件，参照计算与维护细则处理。