

深证公司债、信用债及信用等级债指数 编制方案

为反映深市公司债、信用债与不同信用等级信用债的整体表现，提供更丰富的指数化投资标的，编制深证信用债综合指数、深证公司债综合指数、深证中高等级信用债指数和深证中低等级信用债指数。

一、代码与名称

指数名称：深证信用债综合指数

指数简称：深信用债

英文名称：SZSE Credit Bond Index

英文简称：SZSE Credit Bond

指数代码：399301

指数名称：深证公司债综合指数

指数简称：深公司债

英文名称：SZSE Corporate Bond Index

英文简称：SZSE Corporate Bond

指数代码：399302

指数名称：深证中高等级信用债指数

指数简称：深信中高

英文名称：SZSE Medium-High Grade Credit Bond Index

英文简称：SZSE M-H Credit Bond

指数代码：399298

指数名称：深证中低等级信用债指数

指数简称：深信中低

英文名称：SZSE Medium-Low Grade Credit Bond Index

英文简称：SZSE M-L Credit Bond

指数代码：399299

二、基日与基点

指数基日为 2008 年 12 月 31 日，基点为 100 点。

三、选样空间

深证信用债综合指数涵盖在深圳证券交易所上市的企业债、公司债及分离式可转债；深证公司债综合指数涵盖在深圳证券交易所上市的公司债及分离式可转债。债券的信用级别为投资级以上。债券币种为人民币。

深证信用等级债选取在深圳证券交易所上市非 **ST** 的企业债和公司债。深证中高等级信用债指数的样本债券要求为信用级别在 **AA+** 及以上的投资级债券；深证中低等级信用债指数的

样本债券要求为信用级别为 AA+ 及以下的投资级债券。

四、选样方法

该系列指数的样本数量不限，按照下列原则进行选取：

发行量：暂不考虑发行量限制。

债券剩余期限：一年以上。

付息方式：固定利率付息和一次还本付息。

五、指数计算

以样本债券的发行量为权数进行加权，依据下列公式逐日连锁计算：

$$\text{Index}_t = \text{Index}_{t-1} \times \frac{\sum_i (P_{i,t} + AI_{i,t}) * Q_{i,t-1} + \sum_i CPN_{i,t}}{\sum_i (P_{i,t-1} + AI_{i,t-1}) * Q_{i,t-1}}$$

$P_{i,t}$ ：第 i 只债券第 t 日实时成交价。

$AI_{i,t}$ ：第 i 只债券第 t 日应计利息。

$Q_{i,t}$ ：第 i 只债券第 t 日发行量。

$CPN_{i,t}$ ：第 i 只债券第 t 日息票现金流。

样本债券价格选取：每个交易日集合竞价开市后用样本债券的开市价计算开市指数，其后在交易时间内用样本债券的实时成交价计算实时指数，收市后用样本债券的收市价计算收市指数。样本债券当日无成交的，取上一交易日收市价。样本债券暂停交易的，取最近成交价。

六、样本调整

每月的最后一个交易日，对样本债券进行重新检查，剔除不符合条件的债券，选入符合条件的新债券。

凡有样本债券发生发行量变动，自下个月第一个交易日起修正。