

上证资产支持证券指数系列编制方案

上证资产支持证券指数系列选取在上海证券交易所挂牌的资产支持证券作为指数样本，以反映沪市相应资产支持证券的整体表现。

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
上证资产支持证券指数	上证 ABS	SSE Asset-Backed Security Index	SSE ABS	950115
上证优先级资产支持证券指数	上证优先级 ABS	SSE Senior Tranche Asset-Backed Security Index	SSE Senior Tranche ABS	950116

二、指数基日和基点

该指数系列以 2016 年 12 月 30 日为基日，以 100 点为基点。

三、样本选取方法

1、样本空间

该指数系列样本空间由满足以下条件的债券构成：

(1) 债券种类

指数代码	指数简称	债券种类
950115	上证 ABS	上海证券交易所挂牌的资产支持证券，不包含次级资产支持证券，债券币种为人民币
950116	上证优先级 ABS	上海证券交易所挂牌的优先级资产支持证券，债券币种为人民币

(2) 信用评级：AA 及以上；

(3) 剩余期限：1 个月以上。

2、选样方法

选取样本空间内所有债券作为指数样本。

四、指数计算

该指数系列计算公式为：

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

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，其他计算用数据和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，定期调整数据截止日为生效日前一交易日。

2、临时调整

满足条件的新发债券自上市次日起进入指数。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。