

上证地方政府债指数系列编制方案

上证地方政府债指数系列从上海证券交易所上市的地方政府债中，选取符合条件的债券作为指数样本，以反映上海证券交易所相应类型、期限地方政府债的整体表现。

一、指数名称和代码

指数名称	指数简称	指数英文名称	指数英文简称	指数代码
上证地方政府债指数	上证地债	SSE Local Government Bond Index	SSE Local Government Bond	950311
上证地方政府一般债指数	上证一般地债	SSE Local Government General Bond Index	SSE Local Government General Bond	950312
上证地方政府专项债指数	上证专项地债	SSE Local Government Special Bond Index	SSE Local Government Special Bond	950313
上证 3 年期地方政府债指数	上证 3 年期地债	SSE 3-Year Local Government Bond Index	SSE 3-Year Local Government	950046
上证 5 年期地方政府债指数	上证 5 年期地债	SSE 5-Year Local Government Bond Index	SSE 5-Year Local Government	950045
上证 10 年期地方政府债指数	上证 10 年地债	SSE 10-Year Local Government Bond Index	SSE 10-Year Local Government	950109
上证 1-5 年期地方政府债指数	上证 1-5 年地债	SSE 1-5 Year Local Government Bond Index	SSE 1-5 Year Local Government	950047
上证 3-7 年期地方政府债指数	上证 3-7 年地债	SSE 3-7 Year Local Government Bond Index	SSE 3-7 Year Local Government	950188

二、指数基日和基点

指数代码	指数简称	基日	基点
950311	上证地债	2013/12/31	100
950312	上证一般地债	2015/12/31	100
950313	上证专项地债	2015/12/31	100
950046	上证 3 年期地债	2013/12/31	100
950045	上证 5 年期地债	2013/12/31	100
950109	上证 10 年地债	2013/12/31	100
950047	上证 1-5 年地债	2013/12/31	100
950188	上证 3-7 年地债	2013/12/31	100

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地方政府债，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

选取样本空间中符合如下条件的债券作为各指数样本：

指数代码	指数简称	剩余期限	地方政府债类型
950311	上证地债	无限制	无限制
950312	上证一般地债	无限制	地方政府一般债
950313	上证专项地债	无限制	地方政府专项债
950046	上证 3 年期地债	6 个月以上，4 年及以下	无限制
950045	上证 5 年期地债	4 年以上，5.25 年及以下	无限制
950109	上证 10 年地债	6.5 年以上，10.25 年及以下	无限制
950047	上证 1-5 年地债	0.5 年以上，5.5 年及以下	无限制
950188	上证 3-7 年地债	3 年以上，7 年及以下	无限制

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，报告期样本债券总市值= $\sum[(\text{净价} + \text{应计利息}) \times \text{发行量}]$ 。

指数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、指数样本和权重调整

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。