

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,以反映相应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 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

该指数系列以 2013 年 12 月 31 日为基日,以 100 点为基点。

三、样本选取方法

上证地方政府债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交易的地方政府债, 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;

(3) 剩余期限条件如下:

指数代码	指数简称	剩余期限
950045	上证 5 年期地债	4 年以上, 5.5 年及以下
950109	上证 10 年地债	6.5 年以上, 10.25 年及以下
950047	上证 1-5 年地债	0.5 年以上, 5.5 年及以下
950188	上证 3-7 年地债	3 年以上, 7 年及以下

四、指数计算

上证地方政府债指数系列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 = $\sum[(\text{净价} + \text{应计利息}) \times \text{发行量}]$ 。

该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

上证地方政府债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。