

上证国债及政策性金融债指数系列编制方案

上证国债及政策性金融债指数系列从上海证券交易所上市的国债和政策性金融债中，选取剩余期限符合条件的债券作为指数样本，以反映沪市相应期限国债及政策性金融债的整体表现。

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
上证国债及政策性金融债指数	沪国债及政金债	SSE Treasury and Policy Bank Bond Index	SSE Treasury and Policy Bank Bond	950229
上证 0-1 年国债及政策性金融债指数	沪 0-1 国债及政金债	SSE 0-1Y Treasury and Policy Bank Bond Index	SSE 0-1 Treasury and Policy Bank Bond	950230
上证 0-2 年国债及政策性金融债指数	沪 0-2 国债及政金债	SSE 0-2Y Treasury and Policy Bank Bond Index	SSE 0-2 Treasury and Policy Bank Bond	950176
上证 0-3 年国债及政策性金融债指数	沪 0-3 国债及政金债	SSE 0-3Y Treasury and Policy Bank Bond Index	SSE 0-3 Treasury and Policy Bank Bond	950231
上证 0-5 年国债及政策性金融债指数	沪 0-5 国债及政金债	SSE 0-5Y Treasury and Policy Bank Bond Index	SSE 0-5 Treasury and Policy Bank Bond	950233
上证 1-3 年国债及政策性金融债指数	沪 1-3 国债及政金债	SSE 1-3Y Treasury and Policy Bank Bond Index	SSE 1-3 Treasury and Policy Bank Bond	950232
上证 1-5 年国债及政策性金融债指数	沪 1-5 国债及政金债	SSE 1-5Y Treasury and Policy Bank Bond Index	SSE 1-5 Treasury and Policy Bank Bond	950177
上证 3-5 年国债及政策性金融债指数	沪 3-5 国债及政金债	SSE 3-5Y Treasury and Policy Bank Bond Index	SSE 3-5 Treasury and Policy Bank Bond	950234

二、指数基日和基点

该指数系列以 2007 年 12 月 31 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国债和政策性金融债，不含私募品种，债券币种为人民币；

(2) 付息方式：固定利率付息和一次还本付息。

2、选样方法

选取样本空间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
950229	沪国债及政金债	1 年以上
950230	沪 0-1 国债及政金债	1 年及以下
950176	沪 0-2 国债及政金债	2 年及以下
950231	沪 0-3 国债及政金债	3 年及以下
950233	沪 0-5 国债及政金债	5 年及以下
950232	沪 1-3 国债及政金债	1 年以上，3 年及以下
950177	沪 1-5 国债及政金债	1 年以上，5 年及以下
950234	沪 3-5 国债及政金债	3 年以上，5 年及以下

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、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，定期调整数据提取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。