

## 上证分期限国债指数系列编制方案

上证分期限国债指数系列从上海证券交易所上市的债券中，选取对应剩余期限的国债作为指数样本，反映沪市相应期限国债的市场表现。

### 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 7-20 年国债指数	沪 7-20 年国债	SSE 7-20 Year Treasury Bond Index	SSE 7-20 Year Treasury Bond	950305
上证 7-30 年国债指数	沪 7-30 年国债	SSE 7-30 Year Treasury Bond Index	SSE 7-30 Year Treasury Bond	950306
上证 7-50 年国债指数	沪 7-50 年国债	SSE 7-50 Year Treasury Bond Index	SSE 7-50 Year Treasury Bond	950307
上证 17-30 年国债指数	沪 17-30 年国债	SSE 17-30 Year Treasury Bond Index	SSE 17-30 Year Treasury Bond	950308
上证 17-50 年国债指数	沪 17-50 年国债	SSE 17-50 Year Treasury Bond Index	SSE 17-50 Year Treasury Bond	950309
上证 27-50 年国债指数	沪 27-50 年国债	SSE 27-50 Year Treasury Bond Index	SSE 27-50 Year Treasury Bond	950310

### 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，不包括私募品种，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
950305	沪 7-20 年国债	7 年以上，20 年及以下
950306	沪 7-30 年国债	7 年以上，30 年及以下
950307	沪 7-50 年国债	7 年以上，50 年及以下
950308	沪 17-30 年国债	17 年以上，30 年及以下
950309	沪 17-50 年国债	17 年以上，50 年及以下
950310	沪 27-50 年国债	27 年以上，50 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 =  $\sum [(\text{净价} + \text{应计利息}) \times \text{发行量}]$

该指数系列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。