

上证粤港澳大湾区综合债指数编制方案

上证粤港澳大湾区综合债指数从上海证券交易所上市的信用债和地方政府债中，选取发行人所在地为粤港澳大湾区的债券作为指数样本，以反映上交所粤港澳大湾区综合债的整体表现。

一、指数名称和代码

指数名称：上证粤港澳大湾区综合债指数

指数简称：上证大湾区综合债

英文名称：SSE Greater Bay Area Universal Bond Index

英文简称：SSE Greater Bay Area Universal Bond

指数代码：950193

二、指数基日和基点

该指数以 2014 年 12 月 31 日为基日，以 100 点为基点。

三、样本选取方法

上证粤港澳大湾区综合债指数的样本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公司债、企业债、地方政府债，不包括私募品种和定向发行品种，债券币种为人民币；

(2) 债项评级：信用债 AA 及以上；

(3) 剩余期限：1 年及以上；

(4) 发行人所在地：粤港澳大湾区，其中，信用债发行人所在地为广州市、

佛山市、肇庆市、深圳市、东莞市、惠州市、珠海市、中山市、江门市、香港特别行政区或澳门特别行政区等，地方政府债发行人所在地为广东省、香港特别行政区或澳门特别行政区等；

(5) 付息方式：固定利率付息或一次还本付息。

四、指数计算

上证粤港澳大湾区综合债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 = $\sum(\text{全价} \times \text{发行量})$ ，全价 = 净价 + 应计利息。

该指数计算用价格为中证估值价格，其他计算用基础数据、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

上证粤港澳大湾区综合债指数样本每月调整一次，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

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。