

上证长三角综合债指数编制方案

上证长三角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长三角区域的债券作为指数样本，以反映上交所长三角区域综合债的整体表现。

一、指数名称和代码

指数名称：上证长三角综合债指数

指数简称：上证长三角综合债

英文名称：SSE Yangtze River Delta Area Universal Bond Index

英文简称：SSE Delta Area Universal Bond

指数代码：950191

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

上证长三角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：上海市、浙江省、江苏省或安徽省；

(5) 付息方式：固定利率付息或一次还本付息。

四、指数计算

上证长三角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

上证长三角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。