

上证 30 年期国债指数编制方案

上证 30 年期国债指数从上海证券交易所上市的债券中，选取符合中国金融期货交易所 30 年期国债期货近月合约可交割条件的国债作为指数样本，以反映沪市相应期限国债的整体表现。

一、指数名称和代码

指数名称：上证 30 年期国债指数

指数简称：沪 30 年国债

英文名称：SSE 30-Year China Treasury Bond (Futures Deliverables) Index

英文简称：SSE 30-Year China Treasury Bond

指数代码：950175

二、指数基日和基点

该指数以 2010 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

上证 30 年期国债指数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国债，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。

2、选样方法

在样本空间中，选取符合中国金融期货交易所 30 年期国债期货近月合约可交割条件的债券作为指数样本。

四、指数计算

上证 30 年期国债指数采用派许加权综合价格指数方法计算，计算公式为：

$$\text{报告期指数} = \frac{\text{报告期样本债券总市值}}{\text{除数}} \times 100$$

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 30 年期国债指数样本每季度调整一次，定期调整生效日为国债期货交割月的第二个周五后首个交易日，定期调整数据截止日为生效日前一个交易日。

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。