

上证城投债指数编制方案

上证城投债指数的样本由沪市剩余期限 1 年及以上、债项评级为投资级以上的城投类债券组成。指数采用市值加权计算，以反映沪市相应期限城投债的表现。

一、指数名称和代码

指数名称：上证城投债指数

指数简称：沪城投债

英文名称：SSE Urban Construction Investment Bond Index

英文简称：SSE Urban Construction Investment Bond

指数代码：H11098

二、指数基日和基点

该指数以 2008 年 12 月 31 日为基日，以 100 点为基点。

三、样本选取方法

上证城投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城投债，债券币种为人民币；
- (2) 信用评级：投资级以上；
- (3) 债券剩余期限：1 年及以上；
- (4) 付息方式：固定利率付息或一次还本付息。

四、指数计算

上证城投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=Σ（全价×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、样本调整

1、定期调整

上证城投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第二个交易日。

2、临时调整

若样本券发生暂停上市、摘牌等事件，自下一定期调样生效日起剔除出指数；样本券发生其他事件，参照计算与维护细则处理。