上证 1-5 年期地方政府债指数编制方案

上证 1-5 年期地方政府债指数样本券由在上海证券交易所上市的剩余期限为 6 个月以上、5.5 年及以下的地方政府债组成。指数采用市值加权计算，以反映沪市相应期限地方政府债券的整体表现。

一、指数名称和代码

指数名称：上证 1-5 年期地方政府债指数

指数简称：上证 1-5 年地债

指数英文名称：SSE 1-5 Year Local Government Bond Index

指数英文简称：SSE 1-5 Year Local Government

指数代码：950047

二、指数基日和基点

该指数以 2013 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 1-5 年期地方政府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：在上海证券交易所市场上市的地方政府债，债券币种为人民币；

（2）债券剩余期限：6 个月以上，5.5 年及以下；

（3）付息方式：固定利率付息或一次还本付息。

2、选样方法

选取样本空间内所有债券作为指数样本券。

四、指数计算

上证 1-5 年期地方政府债指数采用派许加权综合价格指数方法计算，计算公式为:

$$报告期指数 = \frac{报告期样本债券的总市值 + 报告期债券派息}{除数} \times 100$$

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。

该指数采用中证估值价格进行计算，取价规则、应计利息、除数修正方法参见计算与维护细则。

五、样本调整

1、定期调整

上证 1-5 年期地方政府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

若样本券发生暂停上市、摘牌等事件，视情况自事件生效之日起剔除出指数；样本券发生其他事件，参照计算与维护细则处理。