

中证 1-5 年期地方政府债指数编制方案

中证 1-5 年期地方政府债指数样本券由在沪深交易所或银行间市场上市、剩余期限为 6 个月以上、5 年及以下的非定向地方政府债组成。指数采用市值加权计算，以反映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：中证 1-5 年期地方政府债指数

指数简称：1-5 年地债

英文名称：CSI 1-5 Year Local Government Bond Index

英文简称：1-5 Year Local Government

指数代码：931336

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

中证 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：在沪深交易所或银行间市场上市的地方政府债，不包括定向发行的品种，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

选取样本空间中剩余期限在 6 个月以上、5 年及以下的债券作为指数样本券。

四、指数计算

中证 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：

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

其中，报告期样本债券总市值 = \sum (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

中证 1-5 年期地方政府债指数样本每季度调整一次，定期调整生效日为每年 1 月、4 月、7 月和 10 月份的首个交易日，定期调整数据提取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。