

上证 2 年期国债指数编制方案

上证 2 年期国债指数样本由在上海证券交易所挂牌、符合 2 年期国债期货近月合约可交割条件的国债组成。指数采用市值加权计算，反映沪市相应关键期限国债的市场表现。

一、指数名称和代码

指数名称：上证 2 年期国债指数

指数简称：2 年国债

英文名称：SSE 2-Year China Treasury Note (Futures Deliverables) Index

英文简称：2-Year China Treasury Note

指数代码：950084

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

1、样本空间

上证 2 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：在上海证券交易所挂牌的国债，且在国债期货交割月的全部可交割日满足国债转托管条件，债券币种为人民币；

(2) 剩余期限：国债期货交割月首日位于 1.5 年以上，2.25 年以下；

(3) 付息方式：固定利率付息。

2、选样方法

在样本空间中，选取符合 2 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 2 年期国债指数采用派许加权综合价格指数公式计算，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 = Σ (全价 \times 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 2 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，定期调整数据提取日为生效日前一交易日。

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。