

中证分区域地方政府债指数系列编制方案

中证分区域地方政府债指数系列包括 22 条指数，覆盖长三角区域、江苏省、浙江省等省份和区域。其中 1-3 年期指数共 11 条，1-5 年期指数共 11 条。指数采用市值加权计算，反映相应区域、相应期限地方政府债市场表现。

一、指数名称和代码

| 指数名称 | 指数简称 | 英文名称 | 英文简称 | 指数代码 |
|---------------------|------------|---|--------------------------------------|--------|
| 中证 1-5 年期长三角地方政府债指数 | 1-5 年长三角地债 | CSI 1-5 Year Yangtze River Delta Area Local Government Bond Index | 1-5 Year Delta Area Local Government | 931314 |
| 中证 1-5 年期江苏省地方政府债指数 | 1-5 年江苏债 | CSI 1-5 Year Jiangsu Province Local Government Bond Index | 1-5 Year Jiangsu Local Government | 931315 |
| 中证 1-5 年期山东省地方政府债指数 | 1-5 年山东债 | CSI 1-5 Year Shandong Province Local Government Bond Index | 1-5 Year Shandong Local Government | 931316 |
| 中证 1-5 年期四川省地方政府债指数 | 1-5 年四川债 | CSI 1-5 Year Sichuan Province Local Government Bond Index | 1-5 Year Sichuan Local Government | 931317 |
| 中证 1-5 年期湖南省地方政府债指数 | 1-5 年湖南债 | CSI 1-5 Year Hunan Province Local Government Bond Index | 1-5 Year Hunan Local Government | 931318 |
| 中证 1-5 年期贵州省地方政府债指数 | 1-5 年贵州债 | CSI 1-5 Year Guizhou Province Local Government Bond Index | 1-5 Year Guizhou Local Government | 931319 |
| 中证 1-5 年期河南省地方政府债指数 | 1-5 年河南债 | CSI 1-5 Year Henan Province Local Government Bond Index | 1-5 Year Henan Local Government | 931320 |
| 中证 1-5 年期浙江省地方政府债指数 | 1-5 年浙江债 | CSI 1-5 Year Zhejiang Province Local Government Bond Index | 1-5 Year Zhejiang Local Government | 931321 |

| | | | | |
|-----------------------------|----------------|--|---|--------|
| 中证 1-5 年期 广东省地方政府 债指数 | 1-5 年广 东债 | CSI 1-5 Year Guangdong Province Local Government Bond Index | 1-5 Year Guangdong Local Government | 931322 |
| 中证 1-5 年期 河北省地方政 府债指数 | 1-5 年河 北债 | CSI 1-5 Year Hebei Province Local Government Bond Index | 1-5 Year Hebei Local Government | 931323 |
| 中证 1-5 年期 云南省地方政 府债指数 | 1-5 年云 南债 | CSI 1-5 Year Yunnan Province Local Government Bond Index | 1-5 Year Yunnan Local Government | 931324 |
| 中证 1-3 年期 长三角地方政 府债指数 | 1-3 年长 三角地债 | CSI 1-3 Year Yangtze River Delta Area Local Government Bond Index | 1-3 Year Delta Area Local Government | 931325 |
| 中证 1-3 年期 江苏省地方政 府债指数 | 1-3 年江 苏债 | CSI 1-3 Year Jiangsu Province Local Government Bond Index | 1-3 Year Jiangsu Local Government | 931326 |
| 中证 1-3 年期 山东省地方政 府债指数 | 1-3 年山 东债 | CSI 1-3 Year Shandong Province Local Government Bond Index | 1-3 Year Shandong Local Government | 931327 |
| 中证 1-3 年期 四川省地方政 府债指数 | 1-3 年四 川债 | CSI 1-3 Year Sichuan Province Local Government Bond Index | 1-3 Year Sichuan Local Government | 931328 |
| 中证 1-3 年期 湖南省地方政 府债指数 | 1-3 年湖 南债 | CSI 1-3 Year Hunan Province Local Government Bond Index | 1-3 Year Hunan Local Government | 931329 |
| 中证 1-3 年期 贵州省地方政 府债指数 | 1-3 年贵 州债 | CSI 1-3 Year Guizhou Province Local Government bond Index | 1-3 Year Guizhou Local Government | 931330 |
| 中证 1-3 年期 河南省地方政 府债指数 | 1-3 年河 南债 | CSI 1-3 Year Henan Province Local Government Bond Index | 1-3 Year Henan Local Government | 931331 |
| 中证 1-3 年期 浙江省地方政 府债指数 | 1-3 年浙 江债 | CSI 1-3 Year Zhejiang Province Local Government Bond Index | 1-3 Year Zhejiang Local Government | 931332 |
| 中证 1-3 年期 广东省地方政 府债指数 | 1-3 年广 东债 | CSI 1-3 Year Guangdong Province Local Government Bond Index | 1-3 Year Guangdong Local Government | 931333 |

| | | | | |
|-----------------------------|--------------|---|-------------------------------------|--------|
| 中证 1-3 年期 河北省地方政府 债指数 | 1-3 年河 北债 | CSI 1-3 Year Hebei Province Local Government Bond Index | 1-3 Year Hebei Local Government | 931334 |
| 中证 1-3 年期 云南省地方政 府债指数 | 1-3 年云 南债 | CSI 1-3 Year Yunnan Province Local Government Bond Index | 1-3 Year Yunnan Local Government | 931335 |

二、指数基日和基点

| 指数代码 | 指数简称 | 基日 | 基点 |
|--------|------------|------------|-----|
| 931314 | 1-5 年长三角地债 | 2013/12/31 | 100 |
| 931315 | 1-5 年江苏债 | 2014/12/31 | 100 |
| 931316 | 1-5 年山东债 | 2014/12/31 | 100 |
| 931317 | 1-5 年四川债 | 2015/12/31 | 100 |
| 931318 | 1-5 年湖南债 | 2015/12/31 | 100 |
| 931319 | 1-5 年贵州债 | 2015/12/31 | 100 |
| 931320 | 1-5 年河南债 | 2015/12/31 | 100 |
| 931321 | 1-5 年浙江债 | 2013/12/31 | 100 |
| 931322 | 1-5 年广东债 | 2013/12/31 | 100 |
| 931323 | 1-5 年河北债 | 2015/12/31 | 100 |
| 931324 | 1-5 年云南债 | 2015/12/31 | 100 |
| 931325 | 1-3 年长三角地债 | 2013/12/31 | 100 |
| 931326 | 1-3 年江苏债 | 2015/12/31 | 100 |
| 931327 | 1-3 年山东债 | 2015/12/31 | 100 |
| 931328 | 1-3 年四川债 | 2015/12/31 | 100 |
| 931329 | 1-3 年湖南债 | 2015/12/31 | 100 |
| 931330 | 1-3 年贵州债 | 2015/12/31 | 100 |
| 931331 | 1-3 年河南债 | 2015/12/31 | 100 |
| 931332 | 1-3 年浙江债 | 2013/12/31 | 100 |
| 931333 | 1-3 年广东债 | 2013/12/31 | 100 |
| 931334 | 1-3 年河北债 | 2015/12/31 | 100 |
| 931335 | 1-3 年云南债 | 2015/12/31 | 100 |

三、样本选取方法

1、样本空间

中证分区域地方政府债指数系列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

选取样本空间中发行人所在地和剩余期限符合如下条件的债券作为各指数的样本券：

| 指数代码 | 指数简称 | 发行人所在地 | 剩余期限 |
|--------|------------|--------------------|----------------|
| 931314 | 1-5 年长三角地债 | 上海市, 浙江省, 江苏省, 安徽省 | 6 个月以上, 5 年及以下 |
| 931315 | 1-5 年江苏债 | 江苏省 | 6 个月以上, 5 年及以下 |
| 931316 | 1-5 年山东债 | 山东省 | 6 个月以上, 5 年及以下 |
| 931317 | 1-5 年四川债 | 四川省 | 6 个月以上, 5 年及以下 |
| 931318 | 1-5 年湖南债 | 湖南省 | 6 个月以上, 5 年及以下 |
| 931319 | 1-5 年贵州债 | 贵州省 | 6 个月以上, 5 年及以下 |
| 931320 | 1-5 年河南债 | 河南省 | 6 个月以上, 5 年及以下 |
| 931321 | 1-5 年浙江债 | 浙江省 | 6 个月以上, 5 年及以下 |
| 931322 | 1-5 年广东债 | 广东省 | 6 个月以上, 5 年及以下 |
| 931323 | 1-5 年河北债 | 河北省 | 6 个月以上, 5 年及以下 |
| 931324 | 1-5 年云南债 | 云南省 | 6 个月以上, 5 年及以下 |
| 931325 | 1-3 年长三角地债 | 上海市, 浙江省, 江苏省, 安徽省 | 6 个月以上, 3 年及以下 |
| 931326 | 1-3 年江苏债 | 江苏省 | 6 个月以上, 3 年及以下 |
| 931327 | 1-3 年山东债 | 山东省 | 6 个月以上, 3 年及以下 |
| 931328 | 1-3 年四川债 | 四川省 | 6 个月以上, 3 年及以下 |
| 931329 | 1-3 年湖南债 | 湖南省 | 6 个月以上, 3 年及以下 |
| 931330 | 1-3 年贵州债 | 贵州省 | 6 个月以上, 3 年及以下 |
| 931331 | 1-3 年河南债 | 河南省 | 6 个月以上, 3 年及以下 |
| 931332 | 1-3 年浙江债 | 浙江省 | 6 个月以上, 3 年及以下 |
| 931333 | 1-3 年广东债 | 广东省 | 6 个月以上, 3 年及以下 |
| 931334 | 1-3 年河北债 | 河北省 | 6 个月以上, 3 年及以下 |
| 931335 | 1-3 年云南债 | 云南省 | 6 个月以上, 3 年及以下 |

四、指数计算

中证分区域地方政府债指数系列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 \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

中证分区域地方政府债指数系列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。