

## 中证 0-4 年期地方政府债指数编制方案

中证 0-4 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 4 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 0-4 年期地方政府债指数

指数简称：0-4 年地债

英文名称：CSI 0-4 Year Local Government Bond Index

英文简称：0-4 Year Local Government

指数代码：931161

### 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

中证 0-4 年期地方政府债指数的样本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) 债券剩余期限：4 年及以下；

(3) 付息方式：固定利率付息或一次还本付息。

### 四、指数计算

中证 0-4 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=  $\Sigma$  (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 0-4 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。