

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覆盖多个区域和省份，反映相应区域、相应期限地方政府债的市场表现。

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
中证长三角地方政府债指数	长三角地债	CSI Yangtze River Delta Area Local Government Bond Index	Delta Area Local Government	931414
中证江苏省地方政府债指数	江苏债	CSI Jiangsu Province Local Government Bond Index	Jiangsu Local Government	931415
中证山东省地方政府债指数	山东债	CSI Shandong Province Local Government Bond Index	Shandong Local Government	931416
中证四川省地方政府债指数	四川债	CSI Sichuan Province Local Government Bond Index	Sichuan Local Government	931417
中证湖南省地方政府债指数	湖南债	CSI Hunan Province Local Government Bond Index	Hunan Local Government	931418
中证贵州省地方政府债指数	贵州债	CSI Guizhou Province Local Government Bond Index	Guizhou Local Government	931419
中证河南省地方政府债指数	河南债	CSI Henan Province Local Government Bond Index	Henan Local Government	931420
中证浙江省地方政府债指数	浙江债	CSI Zhejiang Province Local Government Bond Index	Zhejiang Local Government	931421
中证广东省地方政府债指数	广东债	CSI Guangdong Province Local Government Bond Index	Guangdong Local Government	931422
中证河北省地方政府债指数	河北债	CSI Hebei Province Local Government Bond Index	Hebei Local Government	931423
中证云南省地方政府债指数	云南债	CSI Yunnan Province Local Government Bond Index	Yunnan Local Government	931424
中证安徽省地方政府债指数	安徽债	CSI Anhui Province Local Government Bond	Anhui Local Government	931425

		Index		
中证福建省地方政府债指数	福建债	CSI Fujian Province Local Government Bond Index	Fujian Local Government	931426
中证湖北省地方政府债指数	湖北债	CSI Hubei Province Local Government Bond Index	Hubei Local Government	931427
中证辽宁省地方政府债指数	辽宁债	CSI Liaoning Province Local Government Bond Index	Liaoning Local Government	931428
中证内蒙古自治区地方政府债指数	内蒙古债	CSI Inner Mongolia Autonomous Region Local Government Bond Index	Inner Mongolia Local Government	931429
中证1-5年期安徽省地方政府债指数	1-5 年安徽债	CSI 1-5 Year Anhui Province Local Government Bond Index	1-5 Year Anhui Local Government	931430
中证1-5年期福建省地方政府债指数	1-5 年福建债	CSI 1-5 Year Fujian Province Local Government Bond Index	1-5 Year Fujian Local Government	931431
中证1-5年期湖北省地方政府债指数	1-5 年湖北债	CSI 1-5 Year Hubei Province Local Government Bond Index	1-5 Year Hubei Local Government	931432
中证1-5年期辽宁省地方政府债指数	1-5 年辽宁债	CSI 1-5 Year Liaoning Province Local Government Bond Index	1-5 Year Liaoning Local Government	931433
中证1-5年期内蒙古自治区地方政府债指数	1-5 年内蒙古债	CSI 1-5 Year Inner Mongolia Autonomous Region Local Government Bond Index	1-5 Year Inner Mongolia Local Government	931434
中证1-3年期安徽省地方政府债指数	1-3 年安徽债	CSI 1-3 Year Anhui Province Local Government Bond Index	1-3 Year Anhui Local Government	931435
中证1-3年期福建省地方政府债指数	1-3 年福建债	CSI 1-3 Year Fujian Province Local Government Bond Index	1-3 Year Fujian Local Government	931436
中证1-3年期湖北省地方政府债指数	1-3 年湖北债	CSI 1-3 Year Hubei Province Local Government Bond Index	1-3 Year Hubei Local Government	931437
中证1-3年期辽宁省地方政府债指数	1-3 年辽宁债	CSI 1-3 Year Liaoning Province Local Government Bond Index	1-3 Year Liaoning Local Government	931438
中证1-3年期内蒙古自治区地方政府债指数	1-3 年内蒙古债	CSI 1-3 Year Inner Mongolia Autonomous Region Local Government Bond Index	1-3 Year Inner Mongolia Local Government	931439

二、指数基日和基点

指数代码	指数简称	基日	基点
931414	长三角地债	2013/12/31	100
931415	江苏债	2014/12/31	100
931416	山东债	2014/12/31	100
931417	四川债	2015/12/31	100
931418	湖南债	2015/12/31	100
931419	贵州债	2015/12/31	100
931420	河南债	2015/12/31	100
931421	浙江债	2013/12/31	100
931422	广东债	2013/12/31	100
931423	河北债	2015/12/31	100
931424	云南债	2015/12/31	100
931425	安徽债	2015/12/31	100
931426	福建债	2015/12/31	100
931427	湖北债	2015/12/31	100
931428	辽宁债	2015/12/31	100
931429	内蒙古债	2015/12/31	100
931430	1-5 年安徽债	2015/12/31	100
931431	1-5 年福建债	2015/12/31	100
931432	1-5 年湖北债	2015/12/31	100
931433	1-5 年辽宁债	2015/12/31	100
931434	1-5 年内蒙古债	2015/12/31	100
931435	1-3 年安徽债	2015/12/31	100
931436	1-3 年福建债	2015/12/31	100
931437	1-3 年湖北债	2015/12/31	100
931438	1-3 年辽宁债	2015/12/31	100
931439	1-3 年内蒙古债	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
931414	长三角地债	上海市、浙江省、江苏省、安徽省	3 个月以上
931415	江苏债	江苏省	3 个月以上
931416	山东债	山东省	3 个月以上
931417	四川债	四川省	3 个月以上
931418	湖南债	湖南省	3 个月以上
931419	贵州债	贵州省	3 个月以上
931420	河南债	河南省	3 个月以上
931421	浙江债	浙江省	3 个月以上
931422	广东债	广东省	3 个月以上
931423	河北债	河北省	3 个月以上
931424	云南债	云南省	3 个月以上
931425	安徽债	安徽省	3 个月以上
931426	福建债	福建省	3 个月以上
931427	湖北债	湖北省	3 个月以上
931428	辽宁债	辽宁省	3 个月以上
931429	内蒙古债	内蒙古自治区	3 个月以上
931430	1-5 年安徽债	安徽省	6 个月以上，5 年及以下
931431	1-5 年福建债	福建省	6 个月以上，5 年及以下
931432	1-5 年湖北债	湖北省	6 个月以上，5 年及以下
931433	1-5 年辽宁债	辽宁省	6 个月以上，5 年及以下
931434	1-5 年内蒙古债	内蒙古自治区	6 个月以上，5 年及以下
931435	1-3 年安徽债	安徽省	6 个月以上，3 年及以下
931436	1-3 年福建债	福建省	6 个月以上，3 年及以下
931437	1-3 年湖北债	湖北省	6 个月以上，3 年及以下
931438	1-3 年辽宁债	辽宁省	6 个月以上，3 年及以下
931439	1-3 年内蒙古债	内蒙古自治区	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。