

中证可转换债券平衡策略指数编制方案

中证可转换债券平衡策略指数从沪深交易所上市的可转换公司债券中，通过转股溢价率和到期收益率筛选，选取兼具股性和债性的平衡型转债组成样本券，指数采用市值加权计算。

一、指数名称和代码

指数名称：中证可转换债券平衡策略指数

指数简称：中证转债平衡策略

英文名称：CSI Convertible Bond Balanced Strategy Index

英文简称：CSI Convertible Bond Balanced Strategy

指数代码：931340

二、指数基日和基点

该指数以 2016 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

中证可转换债券平衡策略指数的样本空间由满足以下条件的债券构成：

(1) 债券种类：在沪深交易所上市的债券，不包括私募品种，债券币种为人民币；

(2) 债券余额：三千万元以上。

2、选样方法

将样本空间中的可转换公司债按纯债到期收益率由高到低、转股溢价率由低

到高综合排序，选取排名前 1/3 的转债作为指数样本券。

四、指数计算

中证可转换债券平衡策略指数采用派许加权综合价格指数方法计算，计算公式为：

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

其中，报告期样本债券总市值 = Σ (全价 \times 发行量 \times 权重因子)，全价=净价+应计利息。权重因子介于 0 和 1 之间，以使个券权重不超过 15%。

该指数计算用价格为交易价格，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

中证可转换债券平衡策略指数样本每月调整一次，定期调整生效日为每月首个交易日，定期调整数据提取日为生效日前第二个交易日。

权重因子随样本定期调整而调整，调整时间与指数样本定期调整实施时间相同。在下一个定期调整日前，权重因子一般固定不变。

2、临时调整

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；若样本券发行人发布赎回公告，自赎回公告日后第五个交易日将该券剔除出指数；样本券发生其他事件，参照计算与维护细则处理。