

上证可转换债券指数编制方案

上证可转换债券指数的样本券由在上海证券交易所上市的可转换债券组成。指数采用市值加权计算，以反映沪市可转换债券的整体表现。

一、指数名称和代码

指数名称：上证可转换债券指数

指数简称：上证转债

英文名称：SSE Convertible Bond Index

英文简称：SSE Convertible Bond

指数代码：000139

二、指数基日和基点

该指数以 2002 年 12 月 31 日为基日，以 100 点为基点。

三、样本选取方法

上证可转换债券指数的样本由满足以下条件的债券构成：

(1) 债券种类：在上海证券交易所上市的可转换公司债券，债券币种为人民币；

(2) 债券余额：3 千万元以上。

四、指数计算

上证可转换债券指数采用派许加权综合价格指数方法计算，公式为：

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

其中,报告期样本债券总市值 = $\Sigma(\text{全价} \times \text{发行量})$,全价=净价+应计利息。

该指数计算用价格为交易价格。当发行量变动累计达到或超过 5%时,对其进行即时调整;当发行量累计变动不及 5%时,则对其进行集中调整。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

上证可转换债券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一个交易日。

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。