**上证可交换债券指数编制方案**

上证可交换债券指数样本券由在上海证券交易所市场上市的可交换公司债券组成。指数采用市值加权计算，以反映沪市可交换公司债券的整体表现。

**一、指数名称和代码**

指数名称：上证可交换债券指数

指数简称：上证可交换债

英文名称：SSE Exchangeable Bond Index

英文简称：SSE Exchangeable Bond

指数代码：950119

**二、指数基日和基点**

该指数以2015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

上证可交换债券指数的样本空间由满足以下条件的债券构成：

1. 债券种类：在上海证券交易所上市的可交换公司债券，不包含私募品种，债券币种为人民币；
2. 付息方式：附息固定、或附息累进、或到期一次还本付息。

2、选样方法

选取样本空间内所有债券作为指数样本券。

**四、指数计算**

上证可交换债券指数采用派许加权综合价格指数方法计算，计算公式为：

其中，报告期样本债券总市值 = ∑（全价×发行量），全价=净价+应计利息。

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

上证可交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；样本券发生其他事件，参照计算与维护细则处理。