

上证可转换债券指数编制方案

一、指数代码、名称

指数代码：000139

指数名称：上证可转换债券指数

指数简称：上证转债

指数英文名称：SSE Convertible Bond Index

指数英文简称：SSE Convertible Bond

二、选样

- 债券种类：在上海证券交易所上市的可转换公司债券。
- 面值余额：3千万元以上。

三、指数计算

（一）基日

基日为2002年12月31日，基点为100点。

（二）指数计算

可转债指数采用派许加权综合价格指数方法计算，公式如下：

报告期指数 = [(报告期指数样本总市值) / 基期] × 基值

其中，总市值 = \sum (全价 × 发行量)

（三）取价规则

- 选取债券实际市场价格用于计算指数，若当日没有交易，则取最近交易日的价格计算指数。

四、指数修正

（一）修正公式

当样本券的市值出现非交易因素的变动时，采用“除数修正法”修正原除数，以保证指数的连续性。修正公式为：

$$\frac{\text{修正前的市值}}{\text{原除数}} = \frac{\text{修正后的市值}}{\text{新除数}}$$

其中，修正后的市值 = 修正前的市值 + 新增（减）市值；

由此公式得出新除数（即修正后的除数，又称新基期），并据此计算以后的指数。

（二）需要修正的几种情况

- 发生指数样本券调整时，在调整实施前一个交易日修正指数。
- 存量余额变动，凡有指数样本发生存量余额变动，在指数样本的存量余额变动日前修正指数。
- 样本券付息后，进行除数调整。

五、样本调整

- 新上市满足选样条件的可转债自次月首个交易日起计入指数。
- 若样本发生停止交易，自停止交易日起剔除出指数。