

上证科创板公司可转换债券指数编制方案

上证科创板公司可转换债券指数从上海证券交易所上市的债券中，选取发行人为科创板上市公司的存续可转换债券作为指数样本，以反映相应可转换债券的整体表现。

一、指数名称和代码

指数名称：上证科创板公司可转换债券指数

指数简称：科创板公司转债

英文名称：SSE STAR Corporate Convertible Bond Index

英文简称：STAR Corporate Convertible Bond

指数代码：950387

二、指数基日和基点

该指数以2022年12月30日为基日，以100点为基点。

三、样本选取方法

上证科创板公司可转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、发行人为科创板上市公司的存续可转换债券，且正股非 ST、*ST，不包括私募品种，债券币种为人民币；

(2) 债券余额：3 千万元以上；

(3) 付息方式：付息固定、或付息累进、或到期一次还本付息。

四、指数计算

上证科创板公司可转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：

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

其中，报告期样本债券总市值 = $\sum[(\text{净价} + \text{应计利息}) \times \text{发行量} \times \text{权重因子}]$ 。
权重因子介于 0 和 1 之间，以使单个样本权重不超过 10%。

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、指数样本和权重调整

1、定期调整

上证科创板公司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

若样本发生摘牌等事件，视情况自事件生效之日起剔除出指数；若样本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；样本发生其他事件，参照计算与维护细则处理。