

深证投资级可转债及可交换债券指数 编制方案

为了反映深市投资级可转换债券、可交换债券的市场特征，丰富金融产品投资标的，编制深证投资级可转债及可交换债券指数。

一、代码与名称

指数名称：深证投资级可转债及可交换债券指数

指数简称：深转交债

英文名称：SZSE Investment Grade Convertible Bond and
Exchangeable Bond Index

英文简称：SZSE Convertible and Exchangeable Bond

指数代码：399290

二、基日与基点

指数基日为 2017 年 12 月 29 日，基点为 100 点。

三、选样空间

指数以在深圳证券交易所上市的正股非 ST、*ST 的可转换

债券、可交换债券为备选范围，不包括私募品种，债券币种为人民币。

四、选样方法

该指数的样本数量不限，按照下列原则进行选取：

信用级别：发行主体 **AA** 及以上，且评级展望非负面；

存续规模：不低于 2 亿元；

剩余期限：自指数定期调整日至到期日超过 15 天。

五、指数计算

以样本债券的发行量为权数进行加权，依据下列公式逐日连锁计算：

$$Index_t = Index_{t-1} \times \frac{\sum_i P_{i,t} \times Q_{i,t-1} + \sum_i CPN_{i,t}}{\sum_i P_{i,t-1} \times Q_{i,t-1}}$$

其中：

$P_{i,t}$ 为第 i 只债券在 t 日的成交全价；

$CPN_{i,t}$ 为第 i 只债券在 t 日发生的息票现金流；

$Q_{i,t}$ 为第 i 只债券在 t 日的发行量。

样本债券价格选取：每个交易日集合竞价开市后用样本债券的开市价计算开市指数，其后在交易时间内用样本债券的实

时成交价计算实时指数，收市后用样本债券的收市价计算收市指数。样本债券当日无成交的，取上一交易日收市价。样本债券暂停交易的，取最近成交价。

六、样本调整

1. 样本定期调整方法

每半个月对样本债券进行检视，时间为月中或月末最后一个交易日，剔除不符合条件的债券，选入符合条件的新样本。样本债券定期调整于检视日的下一交易日实施。

2. 样本临时调整方法

若样本发生停止交易，自停止交易日起剔除出指数；样本券发生其他事件，参照计算与维护细则处理。

七、权重调整

凡有指数样本发生存量余额超过 1% 的变动，在指数样本的存量余额变动日的下一交易日对样本债券的权重进行实时修正。