

# 深证可转换债券综合指数编制方案

为反映深市可转债的整体表现，提供更丰富的指数化投资标的，编制深证可转换债券综合指数。

## 一、代码与名称

指数名称：深证可转换债券综合指数

指数简称：深证转债

英文名称：SZSE Convertible Bond Index

英文简称：SZSE Convertible Bond

指数代码：399307

## 二、基日与基点

指数基日为 2011 年 12 月 31 日，基点为 100 点。

## 三、选样空间

- (1) 债券种类：在深圳证券交易所上市的可转换公司债券；
- (2) 面值余额：不小于 3 千万元。

## 四、选样方法

选取符合样本空间条件的所有债券。

## 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

每月的最后一个交易日，根据选样标准对样本债券进行检

视，剔除不符合条件的债券，选入符合条件的新债券。样本债券定期调整于次月的第一个交易日实施。

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。

## 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。

## 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次日对样本债券的权重进行实时修正。