

国证可转换债券综合指数编制方案

(2014年8月)

为反映沪深两市可转债的整体表现，提供更丰富的指数化投资标的，编制国证可转换债券综合指数。

一、指数代码与名称

指数代码：399413

指数简称：国证转债

指数中文全称：国证可转换债券综合指数

指数英文名称：CNI Convertible Bond INDEX

二、基日与基点

指数基日为2011年12月31日，基点为100点。

三、选样标准

- (1) 债券种类：在境内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、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：

$$\text{Index}_t = \text{Index}_{t-1} \times \frac{\sum_i P_{i,t} * Q_{i,t-1} + \sum_i CPN_{i,t}}{\sum_i P_{i,t-1} * Q_{i,t-1}}$$

$P_{i,t}$: 第 i 只债券第 t 日实时成交全价;

$Q_{i,t}$: 第 i 只债券第 t 日发行量;

$CPN_{i,t}$: 第 i 只债券第 t 日息票现金流。

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。

五、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。

六、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。

七、发布与管理

同巨潮 100 指数。

八、 免责声明

同巨潮 100 指数。