

上证分行业可转债及可交换债指数系列编制方案

上证分行业可转债及可交换债指数系列分别选取在上海证券交易所上市的细分行业可转债及可交换债作为各指数样本，以反映不同行业可转债及可交换债的整体表现。

一、指数名称和代码

指数名称	指数简称	英文名称	英文简称	指数代码
上证工业可转债及可交换债指数	上证工业转债及可交换债	SSE Industrials Convertible Bond and Exchangeable Bond Index	SSE Industrials Convertible Bond and Exchangeable Bond	950358
上证原材料可转债及可交换债指数	上证原材料转债及可交换债	SSE Materials Convertible Bond and Exchangeable Bond Index	SSE Materials Convertible Bond and Exchangeable Bond	950359
上证可选消费可转债及可交换债指数	上证可选消费转债及可交换债	SSE Consumer Discretionary Convertible Bond and Exchangeable Bond Index	SSE Consumer Discretionary Convertible Bond and Exchangeable Bond	950360

二、指数基日和基点

指数代码	指数简称	基日	基点
950358	上证工业转债及可交换债	2019/12/31	100
950359	上证原材料转债及可交换债	2021/12/31	100
950360	上证可选消费转债及可交换债	2019/12/31	100

三、样本选取方法

1、样本空间

该指数系列样本空间由满足以下条件的债券构成：

(1) 债券种类：上海证券交易所上市的可转换公司债券和可交换公司债券，且正股为非 ST、*ST，不包括私募品种，债券币种为人民币；

(2) 信用评级：AA 及以上；

(3) 剩余期限：1 个月以上；

(4) 付息方式：固定利率付息或一次还本付息。

2、选样方法

在样本空间内，选取中证行业一级行业分类符合如下条件的债券作为各指数样本。

指数代码	指数简称	中证一级行业
950358	上证工业转债及可交换债	工业
950359	上证原材料转债及可交换债	原材料
950360	上证可选消费转债及可交换债	可选消费

四、指数计算

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 = $\sum[(\text{净价} + \text{应计利息}) \times \text{发行量}]$

指数计算用价格为交易价格，其他计算用数据、除数调整参见计算与维护细

则。

五、样本调整

1、定期调整

该指数系列样本每月调整一次，定期调整生效日为每月首个交易日，定期调整数据截止日为生效日前一交易日。

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；若样本券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。