

天相基金管理公司表现指数编制说明

一、基本情况

指数名称	指数代码	基期	基值	加权方式
宝盈基金	998130	2001-11-30	1000	总份额加权
博时基金	998131	1999-12-31	1000	总份额加权
长城基金	998132	2002-4-19	1000	总份额加权
长盛基金	998133	1999-12-31	1000	总份额加权
大成基金	998134	1999-12-31	1000	总份额加权
富国基金	998135	1999-12-31	1000	总份额加权
国泰基金	998136	1999-12-31	1000	总份额加权
华安基金	998137	1999-12-31	1000	总份额加权
华夏基金	998138	1999-12-31	1000	总份额加权
嘉实基金	998139	1999-12-31	1000	总份额加权
南方基金	998140	1999-12-31	1000	总份额加权
鹏华基金	998141	1999-12-31	1000	总份额加权
融通基金	998142	2001-9-7	1000	总份额加权
易方达	998143	2001-6-22	1000	总份额加权
银河基金	998144	2002-9-20	1000	总份额加权
银华基金	998145	2001-8-10	1000	总份额加权
国投瑞银	998146	2002-9-13	1000	总份额加权
泰达荷银	998147	2003-6-13	1000	总份额加权
万家基金	998148	2003-4-30	1000	总份额加权
金鹰基金	998149	2003-7-4	1000	总份额加权
招商基金	998150	2003-6-6	1000	总份额加权
华宝兴业	998151	2003-8-1	1000	总份额加权
国联安	998152	2003-9-19	1000	总份额加权
海富通	998153	2003-10-10	1000	总份额加权
景顺长城	998154	2003-12-4	1000	总份额加权
广发基金	998155	2003-12-30	1000	总份额加权
长信基金	998156	2005-1-20	1000	总份额加权
东方基金	998157	2005-12-1	1000	总份额加权
东吴基金	998158	2005-2-4	1000	总份额加权
工银瑞信	998159	2005-9-2	1000	总份额加权
光大保德信	998160	2004-9-3	1000	总份额加权
国海富兰克林	998161	2005-6-3	1000	总份额加权
华富基金	998162	2005-3-4	1000	总份额加权

指数名称	指数代码	基期	基值	加权方式
汇丰晋信	998163	2006-5-26	1000	总份额加权
汇添富基金	998164	2005-8-26	1000	总份额加权
建信基金	998165	2005-12-6	1000	总份额加权
交银施罗德	998166	2005-10-14	1000	总份额加权
摩根华鑫	998167	2004-4-1	1000	总份额加权
诺安基金	998168	2004-6-30	1000	总份额加权
上投摩根	998169	2004-9-17	1000	总份额加权
申万巴黎	998170	2004-5-26	1000	总份额加权
泰信基金	998171	2004-7-1	1000	总份额加权
天弘基金	998172	2005-11-3	1000	总份额加权
天治基金	998173	2004-7-9	1000	总份额加权
新华基金	998174	2005-9-23	1000	总份额加权
信诚基金	998175	2006-5-12	1000	总份额加权
信达澳银	998176	2007-3-8	1000	总份额加权
兴业基金	998177	2005-5-11	1000	总份额加权
益民基金	998178	2006-11-21	1000	总份额加权
友邦华泰	998179	2005-4-27	1000	总份额加权
中海基金	998180	2004-10-8	1000	总份额加权
中欧基金	998181	2007-1-29	1000	总份额加权
浦银安盛	998182	2008-4-16	1000	总份额加权
中银基金	998183	2005-2-24	1000	总份额加权
中邮创业	998184	2006-9-28	1000	总份额加权
华商基金	998185	2007-5-15	1000	总份额加权
金元比联	998186	2007-8-15	1000	总份额加权
民生加银	998187	2009-3-27	1000	总份额加权
农银汇理	998188	2008-8-4	1000	总份额加权
诺德基金	998189	2007-4-19	1000	总份额加权

二、 样本空间

以基金管理公司旗下所有基金为样本

三、 指数计算

天相基金管理公司表现指数根据基金净值采用总份额派式加权综合价格指数法计算：

$$\text{报告期指数} = \frac{\text{报告期指数的基金资产净值}}{\text{基期}} \times \text{基期指数}$$

其中：基金资产净值 = Σ (样本基金报告期基金净值 \times 样本基金报告的总份额)

基期 (除数)：基日样本基金资产净值

基期指数：基日的报告期指数

加权方式：基金净值总份额

四、 指数修正

1. 新基金上市第二个交易日进入；
2. 基金摘牌第二个交易日剔除；
3. 遇到分红、基金规模变化、份额变动等情况，按“除数修正法”修正除数，保证指数计算的连续。修正公式为：

$$\text{即日指数} = \frac{\text{即日资产净值}}{\text{调整后前一交易日资产净值}} \times \text{前一交易日收盘指数}$$

五、 指数发布

天相基金管理公司指数 (998130—998189) 通过天相系统、天相网站对外发布。