

天相基金价格指数编制说明

一、 基本情况

指数名称	指数代码	基期	基值	加权方式
基金价格	998016	1998-4-8	1000	总份额加权

二、 样本空间

以所有的封闭式基金作为样本。

三、 指数计算

天相基金价格指数根据基金价格采用总份额派式加权综合价格指数法计算。

$$\text{报告期指数} = \frac{\text{报告期指数的总市值}}{\text{基期}} \times \text{基期指数}$$

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

基期（除数）：基日样本基金总市值

基期指数：基日的报告期指数

加权方式：总份额加权

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；按“除数修正法”进行修正指数：

$$\text{即日指数} = \frac{\text{即日基金总市值}}{\text{调整后前一交易日总市值}} \times \text{前一交易日收盘指数}$$

四、 指数发布

天相基金价格指数通过天相系统、天相网站对外发布。