

## 天相基金风格指数编制说明

### 一、基本情况

指数名称	指数代码	基日	基值	加权方式
股票型	998104	1999-12-31	1000	总份额加权
股票开放型	998105	2001-12-31	1000	总份额加权
混合型	998106	2002-9-27	1000	总份额加权
债券型	998107	2002-10-30	1000	总份额加权
货币型	998108	2004-1-2	0.61487	万份单位收益算术平均
保本型	998109	2003-9-30	1000	总份额加权
积极投资开放型	998110	2003-6-13	1000	总份额加权
纯指数开放型	998111	2003-9-26	1000	总份额加权
增强指数开放型	998112	2003-10-30	1000	总份额加权
特定策略型	998113	2006-9-14	1000	总份额加权
积极投资	998114	2002-6-14	1000	总份额加权
积极股票型	998115	2002-6-14	1000	总份额加权
稳健股票型	998116	1999-12-31	1000	总份额加权
积极股票开放型	998117	2004-6-25	1000	总份额加权
稳健股票开放型	998118	2003-6-13	1000	总份额加权
纯指数型	998119	2003-9-26	1000	总份额加权
增强指数型	998120	1999-12-31	1000	总份额加权
指数型	998121	1999-12-31	1000	总份额加权
指数开放型	998122	2002-12-31	1000	总份额加权
灵活配置型	998123	2001-12-10	1000	总份额加权
积极配置型	998124	2002-10-18	1000	总份额加权
保守配置型	998126	2003-5-30	1000	总份额加权
纯债基金	998128	2002-11-29	1000	总份额加权
一级债基	998197	2002-12-31	1000	总份额加权
二级债基	998129	2002-10-30	1000	总份额加权

### 二、样本空间

天相基金一级分类标准：按照中国证监会对基金类型的有关规定，将基金分为股票型、股票开放型、混合型、债券型、货币型五类。在天相基金一级分类的基础上，主要参考基金合同中规定的资产配置比例、并综合考虑基金的业绩比较基准和风险收益定位，进行细分。具体如下：

- 1、股票型基金：以全部开放式和封闭式股票型基金为样本；

股票型基金按照其投资理念（主动投资/被动投资）的不同分为积极投资股票型基金和指数型基金两类；

积极投资股票型基金依据其资产配置比例中的股票投资上限分为积极股票型基金、稳健股票型基金两类；

指数型基金按照跟踪标的指数的方法和投资策略的不同分为纯指数型基金、增强指数型基金两类。

2、股票开放式：以全部开放式股票型基金为样本

股票开放式基金依据投资理念不同分为积极投资开放式和指数开放式；

积极投资开放式基金依据其资产配置比例中的股票投资上限分为积极股票开放式基金、稳健股票开放式基金两类；

指数开放式基金按照跟踪标的指数的方法和投资策略的不同分为纯指数开放式基金、增强指数开放式基金两类。

3、混合型基金：以全部开放式混合型基金为样本；

根据混合型基金合同中的股票投资上下限间距，上下限范围，是否有保本条款及是否运用了特殊投资策略，将混合型基金划分为灵活配置型、积极配置型、保守配置型、保本型和特定策略型五类。

4、债券型基金：以全部开放式债券型基金为样本

根据债券型基金的投资方式将其划分为四类：

- 理财债基：不投资可转债，不参与一级市场新股申购，不参与二级市场股票交易。
- 纯债基金：不投资可转债，不参与一级市场新股申购及二级市场股票交易，仅投资债券类市场
- 一级债基：除了投资债券类外还可参与一级市场新股申购，但不能参与二级市场股票交易；
- 二级债基：除了投资债券市场外，不仅可参与一级市场新股申购，还可参与二级市场股票交易

5、货币型基金：以全部货币型基金为样本。

### 三、 指数维护

天相基金风格表现指数除货币型基金之外均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 =  $\Sigma$  (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：总份额加权

### 四、 指数调整

新基金上市第二个交易日进入；

基金摘牌第二个交易日剔除。

遇到分红、基金规模变化、份额变动等情况，按“除数修正法”进行修正：

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

### 五、 指数发布

天相基金风格表现指数通过天相投资分析系统对外发布。