

## 天相开放（封闭）式基金净值指数编制说明

### 一、 基本情况

指数名称	指数代码	基期	基值	加权方式
开放式基金	998101	2001-9-27	1000	总份额加权
封闭式基金	998100	1999-12-31	1000	总份额加权

### 二、 样本空间

天相开放式基金指数：以所有开放式基金作为样本；

天相封闭式基金指数：以所有封闭式基金作为样本。

### 三、 指数计算

开放式、封闭式基金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 =  $\Sigma$ （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”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

天相开放（封闭）式基金净值指数通过天相系统、天相网站对外发布。