

## 天相偏股开放指数编制说明

### 一、 基本情况

指数名称	指数代码	基期	基值	加权方式
偏股开放指数	998029	2004-11-30	1160.12	总份额加权

### 二、 样本空间

天相偏股开放指数是由设立半年以上的偏股开放型基金构成的指数。偏股开放型基金按下列规则确定：

根据天相基金风格分类，招募说明书中明确股票投资范围下限在 60%以上的开放式基金；

根据天相基金风格分类，业绩比较基准中股票指数占 60%以上的开放式基金。

### 三、 指数计算

天相偏股开放指数根据基金净值采用派式加权综合价格指数公式计算：

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

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

基日：指数计算的起始交易日

加权方式：基金净值总份额

### 四、 指数调整

偏股开放指数样本每年进行 2 次调整，生效时间分别是 1 月、7 月的第一个交易日。

## 五、 指数修正

遇到分红、基金规模变化、样本股调整等情况，按“除数修正法”进行修正：

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

## 六、 指数发布

天相偏股开放指数通过天相系统、天相网站对外发布。