

深证乐富基金系列指数编制方案

为全面反映深交所上市基金及细分产品的二级市场整体走势，为市场及投资者提供更加丰富的基金业绩评价基准和基金投资参考依据，编制深证乐富基金系列指数，首批指数包含 2 条综合指数：深证乐富基金指数和深证 ETF 指数。

一、代码与名称

指数名称：深证乐富基金指数

指数简称：乐富指数

英文名称：SZSE LEFU Fund Index

英文简称：LEFU Fund

指数代码：399103

指数名称：深证 ETF 指数

指数简称：深证 ETF

英文名称：SZSE ETF Index

英文简称：SZSE ETF

指数代码：399306

二、基日与基点

乐富基金指数基日为 2004 年 12 月 31 日,基点为 1000 点;
深证 ETF 指数基日为 2010 年 12 月 31 日,基点为 1000 点。

三、深证乐富基金系列指数的选样方法

乐富基金指数样本由在深圳证券交易所上市的所有基金组成;

深证 ETF 指数样本由在深圳证券交易所上市的所有 ETF 组成。

四、指数计算方法

$$\text{实时指数} = \text{上一交易日收市指数} \times \frac{\sum (\text{基金实时成交价} \times \text{基金份额})}{\sum (\text{基金上一交易日收市价} \times \text{基金份额})}$$

在上述公式中,“基金份额”为样本基金上个月实际份额的均值,子项和母项的权数相同。

五、指数的调整计算

乐富基金系列指数的调整计算是根据不同情况,在开市前对指数实时计算公式中的有关数据项分别或同时进行调整。

1. 样本股调整

(1) 新基金上市:符合选样范围的新基金在其上市后第二

个交易日开盘时纳入相应综合指数；

(2) 基金终止上市：在终止上市日即时删除。

2. 调整母项中基金的上一交易日收市价

当上市基金进行派息、分拆或其他除权情况，在除权除息日将母项中该基金的上一交易日收市价更新为除权参考价。除权参考价以深圳证券交易所发布的数据为准。

3. 调整子项和母项中基金份额

(1) 月度调整：以上月该基金实际份额的均值作为下个月指数计算时该基金份额；

(2) 基金分拆或其他除权情况：在该基金除权除息日，基于之前指数计算时使用的基金份额数据对该基金份额进行相应比例调整。