

# 中国开放式主动管理基金系列指数编制方案

(2015年1月)

深圳证券信息有限公司、中国基金报与上海证券有限责任公司共同编制发布中国开放式主动管理基金系列指数。该系列指数旨在反映中国开放式主动管理基金的业绩表现，提供业绩评价的基准以及投资决策的参考。

## 一、指数代码与名称

指数代码：CN6070

指数简称：中国股基指数

指数中文全称：中国基金报-上海证券-开放式主动管理股票型基金指数

指数英文名称：CHINAFUND-SHANGHAI SECURITIES-ACTIVE EQUITY FUNDS INDEX

指数代码：CN6071

指数简称：中国混基指数

指数中文全称：中国基金报-上海证券-开放式主动管理混合型基金指数

指数英文名称：CHINAFUND-SHANGHAI SECURITIES-ACTIVE

---

**HYBRID FUNDS INDEX**

指数代码：CN6072

指数简称：中国债基指数

指数中文全称：中国基金报-上海证券-开放式主动管理债券型基金指数

指数英文名称：CHINAFUND-SHANGHAI SECURITIES-ACTIVE

**BOND FUNDS INDEX****二、基日与基点**

指数的基日为 2004 年 12 月 31 日，基点为 1000 点。

**三、选样原则**

指数的样本选取按照以下原则：

- (1) 包含中国开放式主动管理型基金；
- (2) 不包含增强指数型基金、保本型基金；
- (3) 不包含成立时间不满 6 个月的基金。

**中国股基指数**的样本为中国开放式主动管理股票型基金，剔除增强指数型股票基金和成立不满 6 个月的基金；

**中国混基指数**的样本为开放式主动管理混合型基金，剔除保本型基金和成立不满 6 个月的基金；

中国债基指数的样本为开放式主动管理债券型基金，剔除成立不满 6 个月的基金。

#### 四、指数计算

指数采用派氏加权法（基金规模加权）进行计算，计算公式如下：

$$I_{t+1} = I_t * (1 + \sum_{i=1}^{N_{t+1}} R_{i,t+1} * \frac{M_{i,t+1}}{M_{t+1}})$$

其中： $I_t$ 为 t 时刻的指数收盘价；

$N_t$ 为 t 时刻的样本基金个数；

$R_{i,t}$ 为样本基金 i 在 t 时刻的复权单位净值增长率；

$M_{i,t}$ 为样本基金 i 在 t 时刻的基金规模\*。

$M_t$ 为 t 时刻所有样本基金的基金规模总和。

\*注：基金规模为该基金当日的单位净值与上季度末的基金份额之间的乘积。

#### 五、样本调整

## 1. 定期调整

每季度末对市场全部基金的类型进行审核，根据指数选样原则增加或剔除基金样本，并于下一个季度的第一个交易日实施。

## 2. 临时调整

当样本基金有特殊事件发生时，指数样本会进行临时调整。这些事件包括但不限于：

- 1) 基金契约终止，在终止日剔除样本；
- 2) 基金合并或分拆，将在合并与分拆完成后进行指数调整和修正。

## 六、指数的发布与管理

### 1. 指数的发布

通过巨潮指数网（[www.cnindex.com.cn](http://www.cnindex.com.cn)）、上海证券官网（[www.shzq.com](http://www.shzq.com)）、中国基金报发布指数行情数据及样本信息。

### 2. 指数的管理

指数由深圳证券信息有限公司、中国基金报和上海证券有限责任公司联合编制与设计。上海证券有限责任公司负责定期

对样本进行考察，根据考察结果审议是否更换样本，及在官网发布指数点位等指数相关信息。深圳证券信息有限公司指数事业部负责计算与发布指数点位，及指数日常维护工作。中国基金报，负责每周刊登指数点位等指数相关信息。

指数属于深圳证券信息有限公司、中国基金报和上海证券有限责任公司共同资产，未经三方授权许可，任何单位或个人不得跟踪、交易该指数，或以该指数为评价基准。

## 七、免责声明

本文件和其中的所有信息，包括但不限于所有的文字、数据、图表、表格属于深圳证券信息有限公司的财产，受中国知识产权法律及相关法律保护。未经深圳证券信息有限公司书面许可，不得将这些信息全部或部分复制或再次传播。

本文件及其中任何信息均不构成任何证券、金融产品或其他投资工具或任何交易策略的依据或建议，也不表示深圳证券信息有限公司及其关联方关于任何发行人、证券、金融产品或工具或交易策略的意见。

对任何直接或间接使用本文件及其任何信息而造成的损



深证指数 | 国证指数

编制方案 Methodology

---

失，包括但不限于因内容不准确、不完整而导致的损失，深圳  
证券信息公司及其关联方无须承担任何法律责任。