

上证基金指数编制方案

上证基金指数的成份基金是所有在上海证券交易所上市的证券投资基金。该指数自 2000 年 6 月起正式发布，反映了沪市基金价格的整体变动状况。

一、 指数名称和代码

指数名称：上证基金指数

指数简称：基金指数

英文名称：SSE Fund Index

英文简称：Fund Index

指数代码：000011

二、 指数基日和基点

该指数以 2000 年 5 月 8 日为基日，以 1000 点为基点。

三、 样本选取方法

上证基金指数选取所有在上海证券交易所上市交易的证券投资基金，作为指数的样本基金。

四、 指数计算

上证基金指数计算公式为：

$$\text{报告期指数} = \frac{\text{报告期样本基金的调整市值}}{\text{除数}} \times 1000$$

其中，调整市值 = $\sum (\text{价格} \times \text{基金份额数})$ 。基金份额数为最近一期披露的样本基金的份额总数。

五、 指数修正

当指数样本、基金价格出现非交易因素的变动时，采用“除数修正法”进行修正，以保证指数的连续性。需要修正的情况包括：

- 1、基金分红：凡有样本基金分红时，指数不予修正，任其自然回落；
- 2、份额拆分：当有样本基金进行拆分或折算时，指数在样本基金拆分日前按照拆分后的净值进行修正；
- 3、样本调整：当指数样本定期或临时调整生效时，在生效日之前修正除数；
- 4、其他需要修正的事件。

六、 指数样本调整

1、 定期调整

上证基金指数的样本每季度调整一次，样本调整实施时间分别是每年 3 月、6 月、9 月和 12 月的第二个星期五收盘后的下一交易日。

2、 临时调整

特殊情况下将对上证基金指数样本进行临时调整。当样本基金暂停上市或退市时，将其从指数样本中剔除。当样本基金发生合并、分拆、停牌等情形时，将根据事件进展情况进行及时的调整和修正。

当出现样本股临时调整，有指数样本股被非样本股替代时，新进指数的基金一般情况下将继承被剔除基金在调整前最后一个交易日的收盘权重，并据此计算新进基金的权重因子。