

# 广发基金指数月报

(2013 年 6 月 3 日—2013 年 6 月 28 日)

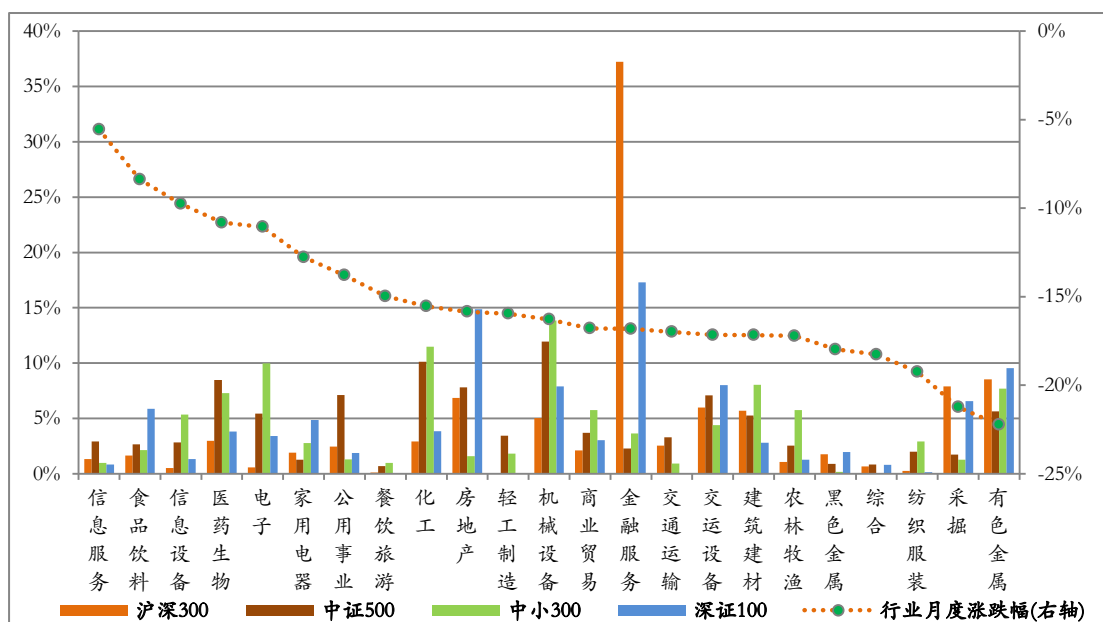
广发基金数量投资部

## 一、广发基金旗下指数基金运作

### (一) 标的指数行业贡献及分布

本月市场大幅下挫，申万一级行业全部下跌，其中信息服务、食品饮料和信息设备行业跌幅小于 10%，而有色金属和采掘行业跌幅超过 20%。从各指数成份股的行业贡献率来看，金融服务行业的下跌对沪深 300 指数影响最大，贡献率为 37.2%；机械设备行业下跌对中证 500 指数贡献最大，贡献率为 11.95%；金融服务行业下跌对深证 100P 指数贡献最大，贡献率达 17.3%；机械设备行业下跌对中小 300 贡献居首，贡献率为 13.9%。

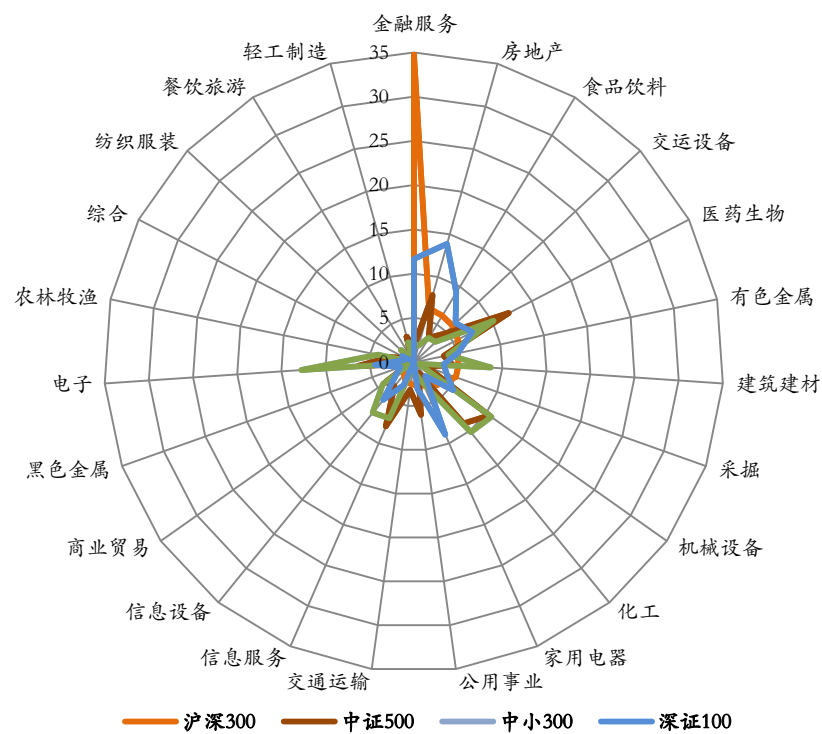
图 1 行业贡献率与月度涨跌幅



以巨潮数据库提供的权重数据计算，本月末金融服务行业在沪深 300 指数中所占权重居首，为 34.8%。医药生物、机械设备和化工行业在中证 500 指数中权重居前，依次为 12.1%、10.4%和 8.91%。房地产、金融服务和食品饮料行业在深证 100P 指数中权重位列前三，依次为 13.9%、11.7%和 9.23%。电子、机械设

备和化工行业在中小 300 指数中权重居前，分别为 12.8%、10.7%和 10.2%。

图 2 行业权重分布（%）



（二）基金运作情况分析

上月广发基金中小板 300ETF 的年化跟踪误差为 0.77%，中证 500 指数(LOF)、沪深 300 指数和中小板 300ETF 联接的年化跟踪误差均在 2.3%以内，取得了较好的跟踪效果。

表 1 基金净值与跟踪误差

| 基金简称            | 2013 年 6 月 |          | 2013 年 5 月 |          | 年化跟踪误差 (%) | 基金成立日期     |
|-----------------|------------|----------|------------|----------|------------|------------|
|                 | 单位净值 (元)   | 累计净值 (元) | 单位净值 (元)   | 累计净值 (元) |            |            |
| 广发中证 500        | 0.7360     | 0.7360   | 0.8620     | 0.8620   | 0.7248     | 2009-11-26 |
| 广发沪深 300        | 0.9790     | 1.2690   | 1.1390     | 1.4290   | 2.2989     | 2008-12-30 |
| 广发中小板 300ETF    | 0.8189     | 0.7440   | 0.9477     | 0.8610   | 0.7748     | 2011-06-03 |
| 广发中小板 300ETF 联接 | 0.7510     | 0.7510   | 0.8626     | 0.8626   | 0.7654     | 2011-06-09 |
| 广发深证 100 分级     | 0.8077     | 0.8306   | 0.9513     | 0.9742   | 1.5674     | 2012-05-07 |

数据来源：申万研究；年化跟踪误差根据基金自然月的数据计算；基金过往投资业绩不预示其未来表现，中国基金成立时间较短，不能反映股市发展的所有阶段

## 二、指数运行情况

6月沪深两市大幅下跌，覆盖两市的申万A指下跌15.2%。指数方面，本期核心市场指数中，创业板指表现最佳，跌幅为5.72%，深证成指跌幅最大，下跌16.89%。

表2 核心指数运行统计

| 指数名称   | 前收盘     | 开盘      | 最高      | 最低      | 收盘      | 涨跌幅     | 成交额（亿元）  |
|--------|---------|---------|---------|---------|---------|---------|----------|
| 上证50   | 1841.37 | 1840.40 | 1854.38 | 1422.98 | 1552.38 | -15.69% | 3346.92  |
| 上证180  | 5649.97 | 5649.30 | 5690.77 | 4398.96 | 4788.85 | -15.24% | 6671.37  |
| 深证成指   | 9257.95 | 9259.48 | 9345.66 | 7045.60 | 7694.47 | -16.89% | 1739.02  |
| 深证100P | 3054.22 | 3053.60 | 3076.42 | 2329.89 | 2545.40 | -16.66% | 3433.49  |
| 中小板指   | 5131.98 | 5125.30 | 5147.61 | 4040.92 | 4456.56 | -13.16% | 2224.15  |
| 中小板300 | 950.01  | 948.45  | 951.91  | 745.65  | 818.25  | -13.87% | 4221.44  |
| 创业板指   | 1073.02 | 1070.73 | 1091.91 | 903.67  | 1011.66 | -5.72%  | 1699.49  |
| 沪深300  | 2606.43 | 2605.97 | 2625.94 | 2023.17 | 2200.64 | -15.57% | 10216.65 |
| 中证500  | 3841.22 | 3836.77 | 3855.79 | 2981.69 | 3235.98 | -15.76% | 6427.20  |
| 申万A指   | 2219.08 | 2217.55 | 2229.90 | 1736.10 | 1881.80 | -15.20% | 28244.99 |

表3 行业指数运行统计

| 指数名称 | 前收盘     | 开盘      | 最高      | 最低      | 收盘      | 涨跌幅     | 成交额（亿元）  |
|------|---------|---------|---------|---------|---------|---------|----------|
| 全指能源 | 2542.84 | 2537.56 | 2570.09 | 1915.60 | 2024.08 | -20.40% | 739.62   |
| 全指材料 | 2371.83 | 2368.55 | 2378.72 | 1785.48 | 1900.63 | -19.87% | 3120.70  |
| 全指工业 | 2477.20 | 2476.43 | 2486.48 | 1915.67 | 2063.01 | -16.72% | 5050.66  |
| 全指可选 | 3345.02 | 3344.08 | 3359.35 | 2662.28 | 2880.02 | -13.90% | 3387.71  |
| 全指消费 | 5771.65 | 5781.57 | 5810.43 | 4833.91 | 5140.45 | -10.94% | 1494.14  |
| 全指医药 | 6475.79 | 6471.72 | 6508.93 | 5330.05 | 5798.42 | -10.46% | 1965.81  |
| 全指金融 | 3862.72 | 3858.91 | 3898.81 | 2902.03 | 3221.14 | -16.61% | 4273.24  |
| 全指信息 | 2942.78 | 2938.45 | 2948.27 | 2414.36 | 2675.65 | -9.08%  | 3656.45  |
| 全指电信 | 3092.12 | 3092.43 | 3121.82 | 2480.78 | 2734.75 | -11.56% | 964.97   |
| 全指公用 | 1808.83 | 1808.75 | 1821.76 | 1433.36 | 1547.16 | -14.47% | 662.85   |
| 中证全指 | 3017.23 | 3015.32 | 3032.37 | 2357.43 | 2557.20 | -15.25% | 27106.45 |

图3 核心指数月度表现

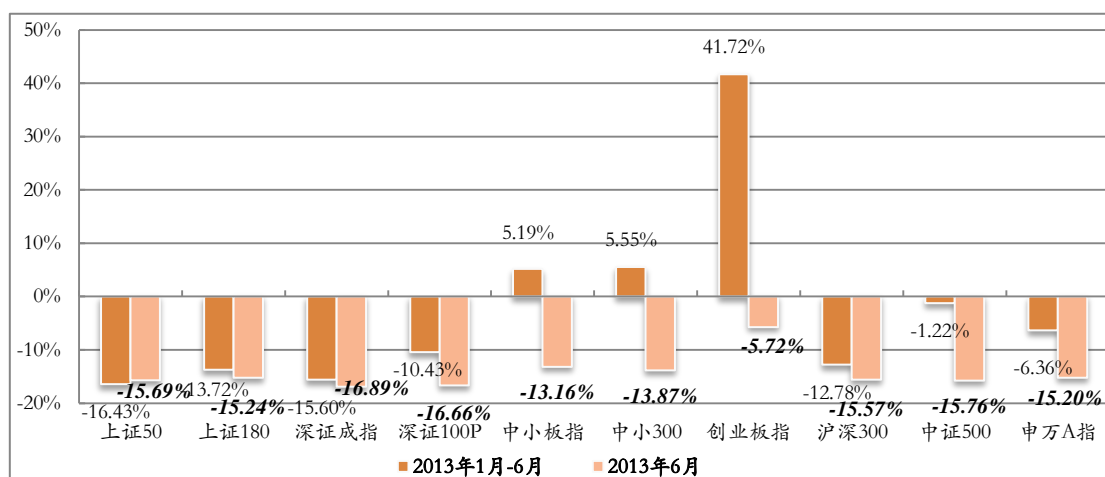


图4 核心指数本月绝对收益

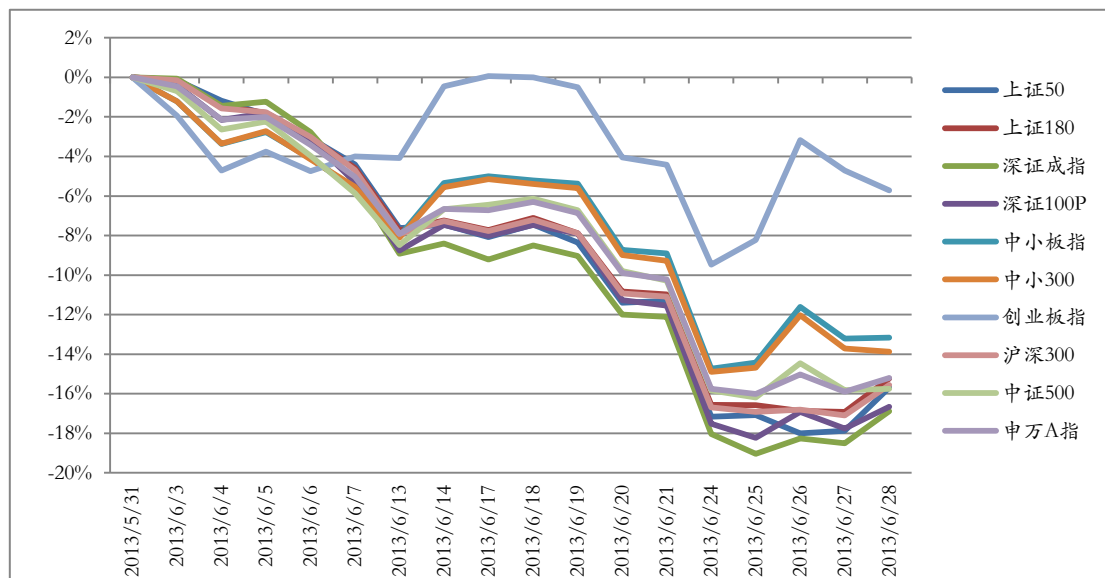
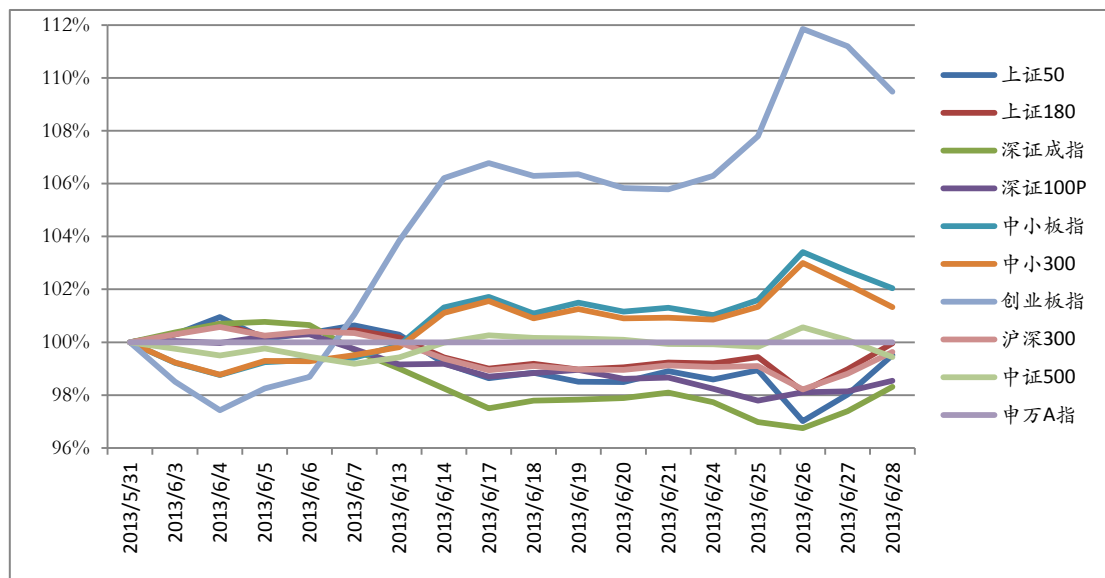


图5 核心指数本月超额收益对比



数据来源：申万研究，超额收益以申万A指（801003）为基准

图 6 行业指数月度表现

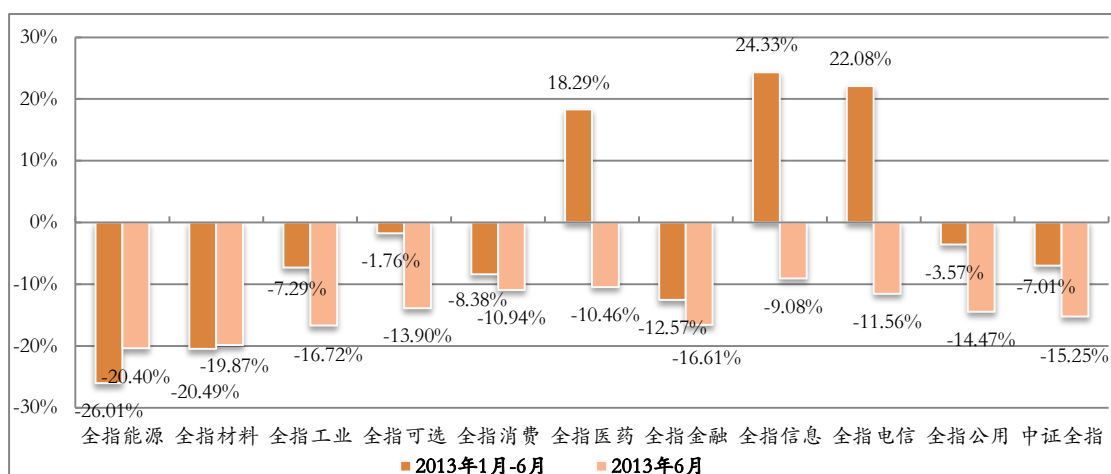


图 7 行业指数本月绝对收益

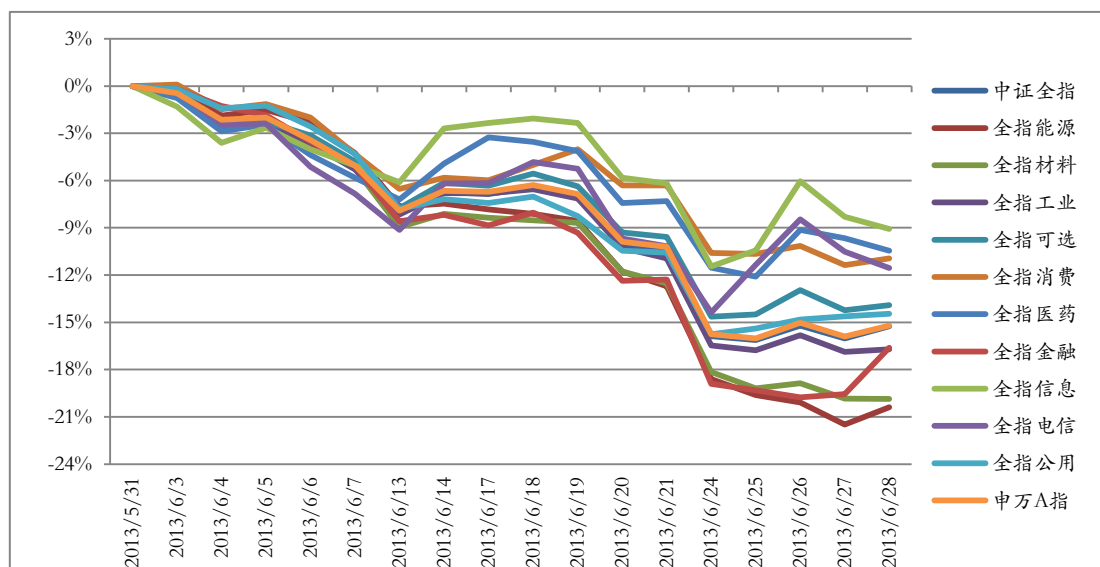
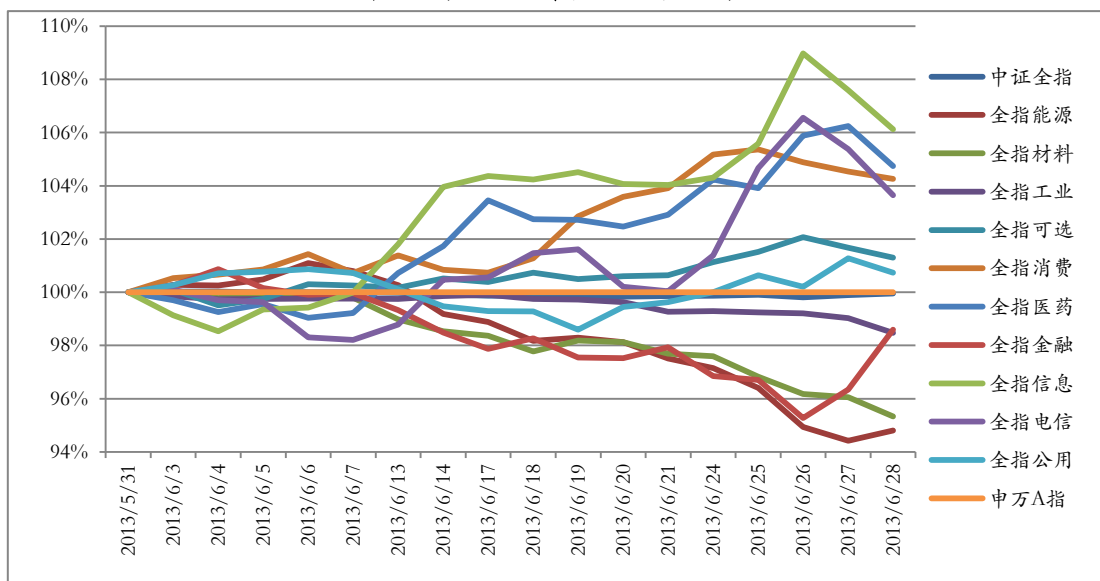


图 8 行业指数本月超额收益对比



数据来源：申万研究，超额收益以申万 A 指（801003）为基准

### 三、指数估值分析

6 月份核心指数的估值水平较 5 月明显回落，市场平均动态（2013 年）市盈率为 9.35 倍（申万 A 指），上证 50 指数的估值水平在主要市场指数中最低，月末动态市盈率为 7.15 倍。

表 4 各主要指数估值水平

| 指数名称    | 静态市盈率 | 滚动市盈率 | 动态市盈率 | 市净率  |
|---------|-------|-------|-------|------|
| 上证 50   | 8.16  | 7.93  | 7.15  | 1.25 |
| 上证 180  | 8.20  | 7.97  | 7.21  | 1.27 |
| 深证成指    | 13.08 | 12.79 | 11.07 | 1.98 |
| 深证 100P | 15.90 | 15.50 | 12.93 | 2.05 |
| 中小板指    | 26.05 | 25.34 | 20.43 | 3.44 |
| 中小板 300 | 27.70 | 26.74 | 21.07 | 3.03 |
| 创业板指    | 46.64 | 44.83 | 32.81 | 4.41 |
| 沪深 300  | 9.05  | 8.76  | 7.92  | 1.35 |
| 中证 500  | 23.64 | 22.42 | 17.04 | 2.02 |
| 申万 A 指  | 11.42 | 10.99 | 9.35  | 1.53 |

表 5 中证全指行业指数估值水平

| 指数名称 | 静态市盈率 | 滚动市盈率 | 动态市盈率 | 市净率  |
|------|-------|-------|-------|------|
| 全指能源 | 12.16 | 12.36 | 10.90 | 1.44 |
| 全指材料 | 27.02 | 26.61 | 20.80 | 1.82 |
| 全指工业 | 17.93 | 17.62 | 13.97 | 1.77 |
| 全指可选 | 19.74 | 19.01 | 15.16 | 2.27 |
| 全指消费 | 20.82 | 19.76 | 16.42 | 3.53 |
| 全指医药 | 38.98 | 37.44 | 29.00 | 4.43 |
| 全指金融 | 8.06  | 7.74  | 7.02  | 1.32 |
| 全指信息 | 44.60 | 42.55 | 30.06 | 3.65 |
| 全指电信 | 38.00 | 35.27 | 25.09 | 2.09 |
| 全指公用 | 17.34 | 15.00 | 12.59 | 1.75 |
| 中证全指 | 13.11 | 12.62 | 10.74 | 1.71 |

## 四、指数样本分析

### 1、上证 50

| 权重前 5 名样本股  |      |        |        |       |       |
|-------------|------|--------|--------|-------|-------|
| 代码          | 简称   | 收盘     | 涨跌幅%   | 换手率%  | 权重%   |
| 600016      | 民生银行 | 8.57   | -16.56 | 13.68 | 9.60  |
| 600036      | 招商银行 | 11.60  | -10.29 | 12.97 | 8.13  |
| 601318      | 中国平安 | 34.76  | -12.24 | 13.88 | 5.77  |
| 601166      | 兴业银行 | 14.77  | -20.33 | 26.31 | 5.58  |
| 600000      | 浦发银行 | 8.28   | -16.53 | 19.02 | 4.59  |
| 贡献前 5 名样本股  |      |        |        |       |       |
| 代码          | 简称   | 收盘     | 涨跌幅%   | 换手率%  | 贡献点数  |
| 600887      | 伊利股份 | 31.28  | 11.95  | 21.09 | 3.78  |
| 601398      | 工商银行 | 4.02   | 2.38   | 8.53  | 0.97  |
| 600519      | 贵州茅台 | 192.37 | 0.81   | 16.17 | 0.54  |
| 601336      | 新华保险 | 24.71  | -0.52  | 41.29 | -0.01 |
| 601800      | 中国交建 | 4.05   | -18.51 | 25.14 | -0.83 |
| 涨跌幅前 5 名样本股 |      |        |        |       |       |
| 代码          | 简称   | 收盘     | 涨跌幅%   | 换手率%  | 贡献点数  |
| 600887      | 伊利股份 | 31.28  | 11.95  | 21.09 | 3.78  |
| 601398      | 工商银行 | 4.02   | 2.38   | 8.53  | 0.97  |
| 600519      | 贵州茅台 | 192.37 | 0.81   | 16.17 | 0.54  |
| 601336      | 新华保险 | 24.71  | -0.52  | 41.29 | -0.01 |
| 601288      | 农业银行 | 2.46   | -3.88  | 9.04  | -2.13 |
| 涨跌幅后 5 名样本股 |      |        |        |       |       |
| 代码          | 简称   | 收盘     | 涨跌幅%   | 换手率%  | 贡献点数  |
| 600188      | 兖州煤业 | 9.40   | -32.96 | 33.64 | -2.14 |
| 600058      | 五矿发展 | 10.90  | -28.66 | 25.05 | -1.44 |
| 601699      | 潞安环能 | 11.96  | -26.90 | 32.04 | -3.10 |
| 601901      | 方正证券 | 5.53   | -26.85 | 59.47 | -4.77 |
| 601898      | 中煤能源 | 4.89   | -25.57 | 15.17 | -2.36 |

## 2、上证 180

| 权重前 5 名样本股  |      |       |        |        |       |
|-------------|------|-------|--------|--------|-------|
| 代码          | 简称   | 收盘    | 涨跌幅%   | 换手率%   | 权重%   |
| 600016      | 民生银行 | 8.57  | -16.56 | 13.68  | 6.09  |
| 600036      | 招商银行 | 11.60 | -10.29 | 12.97  | 5.16  |
| 601318      | 中国平安 | 34.76 | -12.24 | 13.88  | 3.66  |
| 601166      | 兴业银行 | 14.77 | -20.33 | 26.31  | 3.54  |
| 600000      | 浦发银行 | 8.28  | -16.53 | 19.02  | 2.91  |
| 贡献前 5 名样本股  |      |       |        |        |       |
| 代码          | 简称   | 收盘    | 涨跌幅%   | 换手率%   | 贡献点数  |
| 600887      | 伊利股份 | 31.28 | 11.95  | 21.09  | 7.42  |
| 600637      | 百视通  | 28.00 | 18.54  | 58.48  | 3.67  |
| 600893      | 航空动力 | 16.48 | 16.47  | 66.11  | 1.91  |
| 601398      | 工商银行 | 4.02  | 2.38   | 8.53   | 1.87  |
| 600518      | 康美药业 | 19.23 | 3.50   | 35.40  | 1.50  |
| 涨跌幅前 5 名样本股 |      |       |        |        |       |
| 代码          | 简称   | 收盘    | 涨跌幅%   | 换手率%   | 贡献点数  |
| 600637      | 百视通  | 28.00 | 18.54  | 58.48  | 3.67  |
| 600893      | 航空动力 | 16.48 | 16.47  | 66.11  | 1.91  |
| 600887      | 伊利股份 | 31.28 | 11.95  | 21.09  | 7.42  |
| 600373      | 中文传媒 | 17.05 | 8.66   | 139.07 | 0.45  |
| 600518      | 康美药业 | 19.23 | 3.50   | 35.40  | 1.50  |
| 涨跌幅后 5 名样本股 |      |       |        |        |       |
| 代码          | 简称   | 收盘    | 涨跌幅%   | 换手率%   | 贡献点数  |
| 600188      | 兖州煤业 | 9.40  | -32.96 | 33.64  | -4.22 |
| 600844      | 丹化科技 | 7.37  | -30.41 | 23.80  | -1.97 |
| 600456      | 宝钛股份 | 11.73 | -29.89 | 34.06  | -1.62 |
| 600331      | 宏达股份 | 4.05  | -28.95 | 18.57  | -2.04 |
| 600395      | 盘江股份 | 9.15  | -28.85 | 32.95  | -2.76 |



### 3、深证成指

| 权重前 5 名样本股  |      |       |        |       |        |
|-------------|------|-------|--------|-------|--------|
| 代码          | 简称   | 收盘    | 涨跌幅%   | 换手率%  | 权重%    |
| 000002      | 万科 A | 9.85  | -17.78 | 22.22 | 12.03  |
| 000651      | 格力电器 | 25.06 | -6.53  | 16.90 | 7.99   |
| 000001      | 平安银行 | 9.97  | -23.33 | 31.69 | 5.92   |
| 000858      | 五粮液  | 20.04 | -12.66 | 18.11 | 5.08   |
| 000776      | 广发证券 | 11.08 | -21.64 | 17.54 | 4.13   |
| 贡献前 5 名样本股  |      |       |        |       |        |
| 代码          | 简称   | 收盘    | 涨跌幅%   | 换手率%  | 贡献点数   |
| 002241      | 歌尔声学 | 36.29 | 3.57   | 32.63 | 6.82   |
| 000063      | 中兴通讯 | 12.75 | 0.95   | 40.75 | 2.44   |
| 002081      | 金螳螂  | 28.47 | -4.59  | 23.65 | -7.28  |
| 000869      | 张裕 A | 34.14 | -18.40 | 72.68 | -9.72  |
| 002415      | 海康威视 | 35.34 | -5.79  | 28.00 | -10.72 |
| 涨跌幅前 5 名样本股 |      |       |        |       |        |
| 代码          | 简称   | 收盘    | 涨跌幅%   | 换手率%  | 贡献点数   |
| 002241      | 歌尔声学 | 36.29 | 3.57   | 32.63 | 6.82   |
| 000063      | 中兴通讯 | 12.75 | 0.95   | 40.75 | 2.44   |
| 002081      | 金螳螂  | 28.47 | -4.59  | 23.65 | -7.28  |
| 002415      | 海康威视 | 35.34 | -5.79  | 28.00 | -10.72 |
| 000538      | 云南白药 | 84.01 | -6.15  | 15.15 | -16.54 |
| 涨跌幅后 5 名样本股 |      |       |        |       |        |
| 代码          | 简称   | 收盘    | 涨跌幅%   | 换手率%  | 贡献点数   |
| 000933      | 神火股份 | 4.46  | -30.52 | 22.55 | -19.77 |
| 000758      | 中色股份 | 10.13 | -29.75 | 28.99 | -28.96 |
| 000630      | 铜陵有色 | 10.78 | -29.17 | 20.67 | -35.54 |
| 000960      | 锡业股份 | 12.20 | -28.99 | 18.66 | -26.11 |
| 000060      | 中金岭南 | 6.62  | -27.17 | 16.66 | -36.08 |

#### 4、深证 100 价格指数

| 权重前 5 名样本股  |      |       |        |       |       |
|-------------|------|-------|--------|-------|-------|
| 代码          | 简称   | 收盘    | 涨跌幅%   | 换手率%  | 权重%   |
| 000002      | 万科 A | 9.85  | -17.78 | 22.22 | 7.61  |
| 000651      | 格力电器 | 25.06 | -6.53  | 16.90 | 5.06  |
| 000001      | 平安银行 | 9.97  | -23.33 | 31.69 | 3.74  |
| 000858      | 五粮液  | 20.04 | -12.66 | 18.11 | 3.21  |
| 000776      | 广发证券 | 11.08 | -21.64 | 17.54 | 2.61  |
| 贡献前 5 名样本股  |      |       |        |       |       |
| 代码          | 简称   | 收盘    | 涨跌幅%   | 换手率%  | 贡献点数  |
| 002241      | 歌尔声学 | 36.29 | 3.57   | 32.63 | 1.43  |
| 000063      | 中兴通讯 | 12.75 | 0.95   | 40.75 | 0.51  |
| 002230      | 科大讯飞 | 46.20 | 0.79   | 71.72 | 0.24  |
| 000839      | 中信国安 | 6.45  | 1.26   | 66.19 | 0.18  |
| 002269      | 美邦服饰 | 8.84  | -22.93 | 62.59 | -0.68 |
| 涨跌幅前 5 名样本股 |      |       |        |       |       |
| 代码          | 简称   | 收盘    | 涨跌幅%   | 换手率%  | 贡献点数  |
| 002241      | 歌尔声学 | 36.29 | 3.57   | 32.63 | 1.43  |
| 000839      | 中信国安 | 6.45  | 1.26   | 66.19 | 0.18  |
| 000063      | 中兴通讯 | 12.75 | 0.95   | 40.75 | 0.51  |
| 002230      | 科大讯飞 | 46.20 | 0.79   | 71.72 | 0.24  |
| 002038      | 双鹭药业 | 58.60 | -2.25  | 21.22 | -0.83 |
| 涨跌幅后 5 名样本股 |      |       |        |       |       |
| 代码          | 简称   | 收盘    | 涨跌幅%   | 换手率%  | 贡献点数  |
| 002155      | 辰州矿业 | 8.04  | -33.50 | 23.19 | -6.46 |
| 000927      | 一汽夏利 | 3.60  | -33.21 | 62.41 | -1.68 |
| 000968      | 煤气化  | 7.28  | -31.64 | 29.41 | -2.09 |
| 002106      | 莱宝高科 | 15.35 | -31.29 | 54.70 | -6.29 |
| 002122      | 天马股份 | 3.57  | -30.92 | 25.41 | -2.05 |

## 5、中小板指数

| 权重前 5 名样本股  |      |       |        |        |        |
|-------------|------|-------|--------|--------|--------|
| 代码          | 简称   | 收盘    | 涨跌幅%   | 换手率%   | 权重%    |
| 002024      | 苏宁云商 | 5.01  | -19.97 | 19.70  | 4.28   |
| 002236      | 大华股份 | 38.23 | -6.87  | 30.82  | 3.76   |
| 002241      | 歌尔声学 | 36.29 | 3.57   | 32.63  | 3.68   |
| 002415      | 海康威视 | 35.34 | -5.79  | 28.00  | 3.24   |
| 002038      | 双鹭药业 | 58.60 | -2.25  | 21.22  | 3.18   |
| 贡献前 5 名样本股  |      |       |        |        |        |
| 代码          | 简称   | 收盘    | 涨跌幅%   | 换手率%   | 贡献点数   |
| 002292      | 奥飞动漫 | 22.39 | 23.84  | 137.27 | 6.46   |
| 002241      | 歌尔声学 | 36.29 | 3.57   | 32.63  | 5.65   |
| 002450      | 康得新  | 27.98 | 3.67   | 51.77  | 4.94   |
| 002261      | 拓维信息 | 14.46 | 26.50  | 356.67 | 4.16   |
| 002104      | 恒宝股份 | 12.91 | 9.59   | 115.45 | 3.12   |
| 涨跌幅前 5 名样本股 |      |       |        |        |        |
| 代码          | 简称   | 收盘    | 涨跌幅%   | 换手率%   | 贡献点数   |
| 002261      | 拓维信息 | 14.46 | 26.50  | 356.67 | 4.16   |
| 002292      | 奥飞动漫 | 22.39 | 23.84  | 137.27 | 6.46   |
| 002104      | 恒宝股份 | 12.91 | 9.59   | 115.45 | 3.12   |
| 002405      | 四维图新 | 13.98 | 4.95   | 160.21 | 2.64   |
| 002450      | 康得新  | 27.98 | 3.67   | 51.77  | 4.94   |
| 涨跌幅后 5 名样本股 |      |       |        |        |        |
| 代码          | 简称   | 收盘    | 涨跌幅%   | 换手率%   | 贡献点数   |
| 002155      | 辰州矿业 | 8.04  | -33.50 | 23.19  | -25.54 |
| 002106      | 莱宝高科 | 15.35 | -31.29 | 54.70  | -24.89 |
| 002037      | 久联发展 | 9.60  | -31.00 | 35.44  | -7.43  |
| 002122      | 天马股份 | 3.57  | -30.92 | 25.41  | -8.10  |
| 002123      | 荣信股份 | 6.93  | -30.28 | 35.96  | -9.77  |

## 6、中小板 300

| 权重前 5 名样本股  |      |       |        |        |       |
|-------------|------|-------|--------|--------|-------|
| 代码          | 简称   | 收盘    | 涨跌幅%   | 换手率%   | 权重%   |
| 002024      | 苏宁云商 | 5.01  | -19.97 | 19.70  | 2.50  |
| 002236      | 大华股份 | 38.23 | -6.87  | 30.82  | 2.20  |
| 002241      | 歌尔声学 | 36.29 | 3.57   | 32.63  | 2.15  |
| 002415      | 海康威视 | 35.34 | -5.79  | 28.00  | 1.89  |
| 002038      | 双鹭药业 | 58.60 | -2.25  | 21.22  | 1.86  |
| 贡献前 5 名样本股  |      |       |        |        |       |
| 代码          | 简称   | 收盘    | 涨跌幅%   | 换手率%   | 贡献点数  |
| 002292      | 奥飞动漫 | 22.39 | 23.84  | 137.27 | 0.69  |
| 002241      | 歌尔声学 | 36.29 | 3.57   | 32.63  | 0.61  |
| 002450      | 康得新  | 27.98 | 3.67   | 51.77  | 0.53  |
| 002148      | 北纬通信 | 32.64 | 24.49  | 263.04 | 0.50  |
| 002261      | 拓维信息 | 14.46 | 26.50  | 356.67 | 0.45  |
| 涨跌幅前 5 名样本股 |      |       |        |        |       |
| 代码          | 简称   | 收盘    | 涨跌幅%   | 换手率%   | 贡献点数  |
| 002261      | 拓维信息 | 14.46 | 26.50  | 356.67 | 0.45  |
| 002148      | 北纬通信 | 32.64 | 24.49  | 263.04 | 0.50  |
| 002292      | 奥飞动漫 | 22.39 | 23.84  | 137.27 | 0.69  |
| 002263      | 大东南  | 6.69  | 19.04  | 191.36 | 0.37  |
| 002259      | 升达林业 | 4.51  | 12.75  | 89.20  | 0.19  |
| 涨跌幅后 5 名样本股 |      |       |        |        |       |
| 代码          | 简称   | 收盘    | 涨跌幅%   | 换手率%   | 贡献点数  |
| 002155      | 辰州矿业 | 8.04  | -33.50 | 23.19  | -2.74 |
| 002036      | 宜科科技 | 6.25  | -32.07 | 28.17  | -0.41 |
| 002106      | 莱宝高科 | 15.35 | -31.29 | 54.70  | -2.67 |
| 002037      | 久联发展 | 9.60  | -31.00 | 35.44  | -0.80 |
| 002490      | 山东墨龙 | 8.23  | -30.96 | 67.66  | -0.56 |

## 7、创业板指 P

| 权重前 5 名样本股  |      |       |        |        |       |
|-------------|------|-------|--------|--------|-------|
| 代码          | 简称   | 收盘    | 涨跌幅%   | 换手率%   | 权重%   |
| 300070      | 碧水源  | 37.68 | -3.58  | 24.23  | 5.94  |
| 300027      | 华谊兄弟 | 28.55 | -6.30  | 13.88  | 4.14  |
| 300058      | 蓝色光标 | 41.70 | -1.53  | 28.58  | 3.33  |
| 300104      | 乐视网  | 25.95 | 19.89  | 159.52 | 3.30  |
| 300024      | 机器人  | 37.15 | -5.23  | 63.12  | 3.21  |
| 贡献前 5 名样本股  |      |       |        |        |       |
| 代码          | 简称   | 收盘    | 涨跌幅%   | 换手率%   | 贡献点数  |
| 300104      | 乐视网  | 25.95 | 19.89  | 159.52 | 5.53  |
| 300059      | 东方财富 | 13.55 | 28.80  | 91.20  | 4.68  |
| 300052      | 中青宝  | 32.68 | 78.58  | 287.71 | 4.18  |
| 300088      | 长信科技 | 21.09 | 19.22  | 86.17  | 3.66  |
| 300002      | 神州泰岳 | 15.99 | 14.79  | 111.56 | 2.16  |
| 涨跌幅前 5 名样本股 |      |       |        |        |       |
| 代码          | 简称   | 收盘    | 涨跌幅%   | 换手率%   | 贡献点数  |
| 300052      | 中青宝  | 32.68 | 78.58  | 287.71 | 4.18  |
| 300059      | 东方财富 | 13.55 | 28.80  | 91.20  | 4.68  |
| 300104      | 乐视网  | 25.95 | 19.89  | 159.52 | 5.53  |
| 300088      | 长信科技 | 21.09 | 19.22  | 86.17  | 3.66  |
| 300148      | 天舟文化 | 13.68 | 17.32  | 309.46 | 0.44  |
| 涨跌幅后 5 名样本股 |      |       |        |        |       |
| 代码          | 简称   | 收盘    | 涨跌幅%   | 换手率%   | 贡献点数  |
| 300048      | 合康变频 | 7.20  | -31.56 | 57.39  | -1.74 |
| 300239      | 东宝生物 | 8.42  | -28.77 | 97.08  | -1.41 |
| 300143      | 星河生物 | 8.10  | -28.06 | 44.73  | -0.83 |
| 300152      | 燃控科技 | 9.00  | -28.00 | 78.16  | -2.18 |
| 300267      | 尔康制药 | 13.50 | -26.63 | 69.93  | -1.55 |

## 8、沪深 300

| 权重前 5 名样本股  |      |       |        |        |       |
|-------------|------|-------|--------|--------|-------|
| 代码          | 简称   | 收盘    | 涨跌幅%   | 换手率%   | 权重%   |
| 600016      | 民生银行 | 8.57  | -16.56 | 13.68  | 4.28  |
| 600036      | 招商银行 | 11.60 | -10.29 | 12.97  | 3.63  |
| 601318      | 中国平安 | 34.76 | -12.24 | 13.88  | 2.58  |
| 601166      | 兴业银行 | 14.77 | -20.33 | 26.31  | 2.49  |
| 000002      | 万科 A | 9.85  | -17.78 | 22.22  | 2.11  |
| 贡献前 5 名样本股  |      |       |        |        |       |
| 代码          | 简称   | 收盘    | 涨跌幅%   | 换手率%   | 贡献点数  |
| 600887      | 伊利股份 | 31.28 | 11.95  | 21.09  | 2.39  |
| 600637      | 百视通  | 28.00 | 18.54  | 58.48  | 1.19  |
| 600315      | 上海家化 | 44.99 | 7.02   | 27.43  | 0.68  |
| 600893      | 航空动力 | 16.48 | 16.47  | 66.11  | 0.63  |
| 601398      | 工商银行 | 4.02  | 2.38   | 8.53   | 0.61  |
| 涨跌幅前 5 名样本股 |      |       |        |        |       |
| 代码          | 简称   | 收盘    | 涨跌幅%   | 换手率%   | 贡献点数  |
| 600637      | 百视通  | 28.00 | 18.54  | 58.48  | 1.19  |
| 600893      | 航空动力 | 16.48 | 16.47  | 66.11  | 0.63  |
| 601216      | 内蒙君正 | 7.50  | 14.68  | 121.46 | 0.19  |
| 600887      | 伊利股份 | 31.28 | 11.95  | 21.09  | 2.39  |
| 600315      | 上海家化 | 44.99 | 7.02   | 27.43  | 0.68  |
| 涨跌幅后 5 名样本股 |      |       |        |        |       |
| 代码          | 简称   | 收盘    | 涨跌幅%   | 换手率%   | 贡献点数  |
| 600157      | 永泰能源 | 5.85  | -34.12 | 110.24 | -1.04 |
| 002155      | 辰州矿业 | 8.04  | -33.50 | 23.19  | -1.37 |
| 600188      | 兖州煤业 | 9.40  | -32.96 | 33.64  | -1.35 |
| 000968      | 煤气化  | 7.28  | -31.64 | 29.41  | -0.42 |
| 002106      | 莱宝高科 | 15.35 | -31.29 | 54.70  | -1.43 |

## 9、中证 500

| 权重前 5 名样本股  |       |        |        |        |       |
|-------------|-------|--------|--------|--------|-------|
| 代码          | 简称    | 收盘     | 涨跌幅%   | 换手率%   | 权重%   |
| 002230      | 科大讯飞  | 46.20  | 0.79   | 71.72  | 1.01  |
| 002450      | 康得新   | 27.98  | 3.67   | 51.77  | 0.88  |
| 000826      | 桑德环境  | 32.27  | -15.82 | 41.92  | 0.83  |
| 000400      | 许继电气  | 27.08  | -10.57 | 43.44  | 0.71  |
| 000661      | 长春高新  | 97.91  | 1.82   | 38.73  | 0.69  |
| 贡献前 5 名样本股  |       |        |        |        |       |
| 代码          | 简称    | 收盘     | 涨跌幅%   | 换手率%   | 贡献点数  |
| 600436      | 片仔癀   | 136.82 | 14.99  | 24.05  | 2.71  |
| 600835      | 上海机电  | 10.99  | 36.69  | 63.57  | 2.60  |
| 002292      | 奥飞动漫  | 22.39  | 23.84  | 137.27 | 1.70  |
| 600880      | 博瑞传播  | 17.63  | 11.09  | 190.17 | 1.69  |
| 600198      | 大唐电信  | 12.96  | 16.03  | 18.82  | 1.45  |
| 涨跌幅前 5 名样本股 |       |        |        |        |       |
| 代码          | 简称    | 收盘     | 涨跌幅%   | 换手率%   | 贡献点数  |
| 600835      | 上海机电  | 10.99  | 36.69  | 63.57  | 2.60  |
| 002292      | 奥飞动漫  | 22.39  | 23.84  | 137.27 | 1.70  |
| 000829      | 天音控股  | 5.56   | 23.56  | 135.57 | 1.31  |
| 600633      | 浙报传媒  | 21.57  | 19.17  | 172.23 | 0.85  |
| 600198      | 大唐电信  | 12.96  | 16.03  | 18.82  | 1.45  |
| 涨跌幅后 5 名样本股 |       |        |        |        |       |
| 代码          | 简称    | 收盘     | 涨跌幅%   | 换手率%   | 贡献点数  |
| 000050      | 深天马 A | 11.73  | -33.40 | 115.59 | -3.70 |
| 000927      | 一汽夏利  | 3.60   | -33.21 | 62.41  | -1.87 |
| 600645      | 中源协和  | 25.19  | -33.15 | 35.77  | -7.04 |
| 600141      | 兴发集团  | 11.20  | -31.53 | 53.73  | -3.44 |
| 600478      | 科力远   | 18.40  | -31.16 | 39.17  | -4.58 |

## 10、申万 A 指

| 权重前 5 名样本股  |       |       |        |        |       |
|-------------|-------|-------|--------|--------|-------|
| 代码          | 简称    | 收盘    | 涨跌幅%   | 换手率%   | 权重%   |
| 600016      | 民生银行  | 8.57  | -16.56 | 13.68  | 2.40  |
| 601318      | 中国平安  | 34.76 | -12.24 | 13.88  | 1.94  |
| 600036      | 招商银行  | 11.60 | -10.29 | 12.97  | 1.51  |
| 601166      | 兴业银行  | 14.77 | -20.33 | 26.31  | 1.28  |
| 600000      | 浦发银行  | 8.28  | -16.53 | 19.02  | 1.11  |
| 贡献前 5 名样本股  |       |       |        |        |       |
| 代码          | 简称    | 收盘    | 涨跌幅%   | 换手率%   | 贡献点数  |
| 600887      | 伊利股份  | 31.28 | 11.95  | 21.09  | 1.21  |
| 600637      | 百视通   | 28.00 | 18.54  | 58.48  | 0.60  |
| 300104      | 乐视网   | 25.95 | 19.89  | 159.52 | 0.34  |
| 600315      | 上海家化  | 44.99 | 7.02   | 27.43  | 0.33  |
| 300059      | 东方财富  | 13.55 | 28.80  | 91.20  | 0.32  |
| 涨跌幅前 5 名样本股 |       |       |        |        |       |
| 代码          | 简称    | 收盘    | 涨跌幅%   | 换手率%   | 贡献点数  |
| 300052      | 中青宝   | 32.68 | 78.58  | 287.71 | 0.26  |
| 002700      | 新疆浩源  | 61.00 | 45.03  | 318.53 | 0.09  |
| 600206      | 有研硅股  | 14.54 | 37.69  | 104.45 | 0.13  |
| 300051      | 三五互联  | 9.10  | 37.67  | 441.43 | 0.09  |
| 600835      | 上海机电  | 10.99 | 36.69  | 63.57  | 0.24  |
| 涨跌幅后 5 名样本股 |       |       |        |        |       |
| 代码          | 简称    | 收盘    | 涨跌幅%   | 换手率%   | 贡献点数  |
| 600817      | ST 宏盛 | 8.28  | -42.70 | 141.12 | -0.15 |
| 601599      | 鹿港科技  | 6.72  | -35.57 | 35.13  | -0.16 |
| 600782      | 新钢股份  | 3.08  | -35.29 | 38.53  | -0.12 |
| 300100      | 双林股份  | 5.37  | -35.08 | 52.56  | -0.07 |
| 600745      | 中茵股份  | 8.98  | -34.40 | 74.24  | -0.10 |



## 附录：部分指标说明

1. 静态市盈率是指以上一年度每股盈利计算的静态市盈率，该年利润,对应最新股本加权，剔除亏损，计算公式如下：

$$\text{静态PE} = \frac{\sum (\text{最新价格}_{\text{个股 (去除亏损)}} \times \text{最新总股本}_{\text{个股 (去除亏损)}})}{\sum (\text{最近年报归属母公司利润}_{\text{个股 (去除亏损)}})}$$

2. 滚动市盈率是指以最近四个季度每股盈利计算的市盈率，对应最新股本加权，剔除亏损，计算公式如下：

$$\text{一年滚动PE} = \frac{\sum (\text{最新价格}_{\text{个股 (去除亏损)}} \times \text{最新总股本}_{\text{个股 (去除亏损)}})}{\sum (\text{最新滚动归属母公司利润}_{\text{个股 (去除亏损)}})}$$

3. 动态市盈率是指以当年预测每股盈利计算的市盈率，通过预测当年 EPS，对应最新股本加权，剔除亏损，假定以 2011 年初为基准点，计算公式如下：

$$\text{动态PE} = \frac{\sum (\text{最新价格}_{\text{个股}} \times \text{最新总股本}_{\text{个股 (去除亏损)}})}{\sum (\text{最新滚动归属母公司利润}_{\text{个股 (去除亏损)}})}$$

4. 成份股对指数贡献点数是指成份股日涨跌幅×权重×指数收盘点位的月度累计值。

5. 行业贡献率=行业涨跌幅×权重/指数涨跌幅

6. 跟踪误差取拟合偏离度的算法：

$$\text{拟合偏离度} = \sqrt{\frac{1}{T} \sum_{t=1}^T (R_{P,t} - R_{I,t})^2} \times 100\%$$

其中： $R_P$  为基金复权净值的收益率序列数据；

$R_I$  为标的指数的收益率序列数据，其中，普通指数基金按 95%×指数收益率+5%银行同业存款收益率的业绩比较基准进行调整，ETF 基金除外；  
 $T$  为根据时间频率和所选时段决定的收益率个数。