

广发基金指数月报

(2013年6月3日-2013年6月28日)

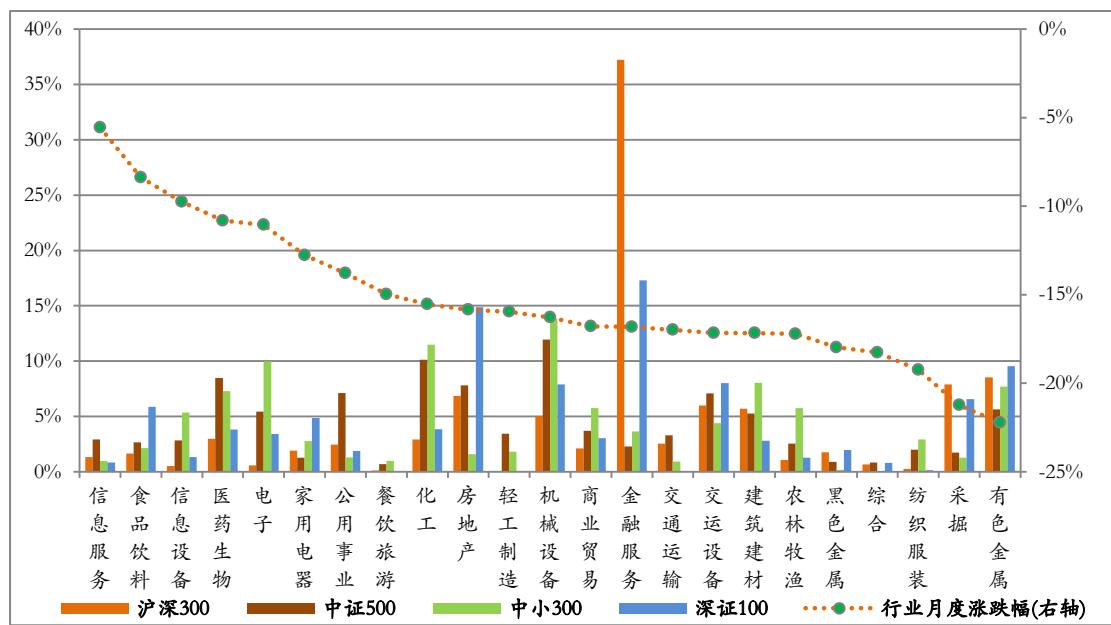
广发基金数量投资部

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%。

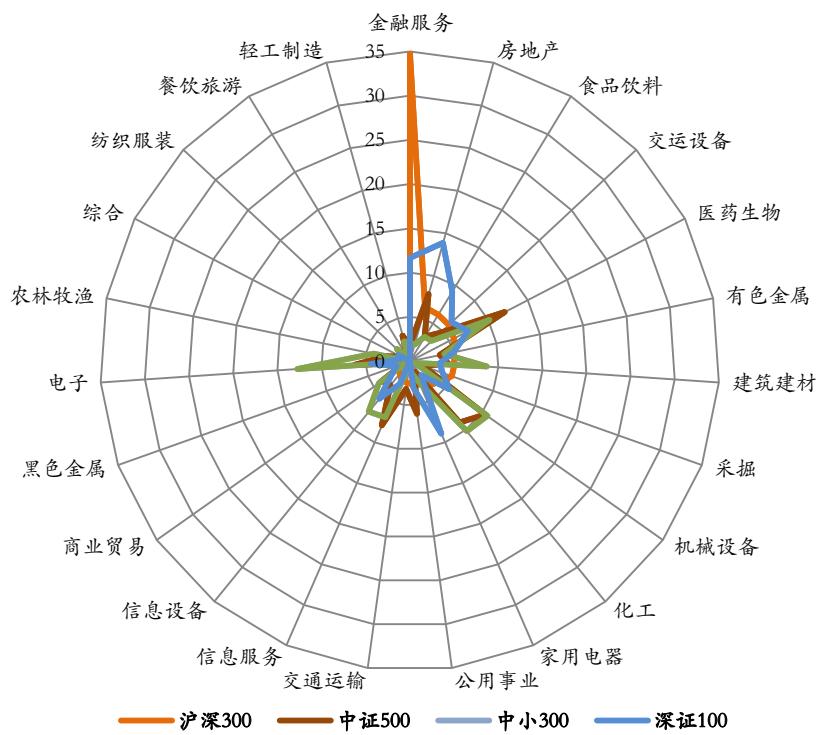
图 1 行业贡献率与月度涨跌幅



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

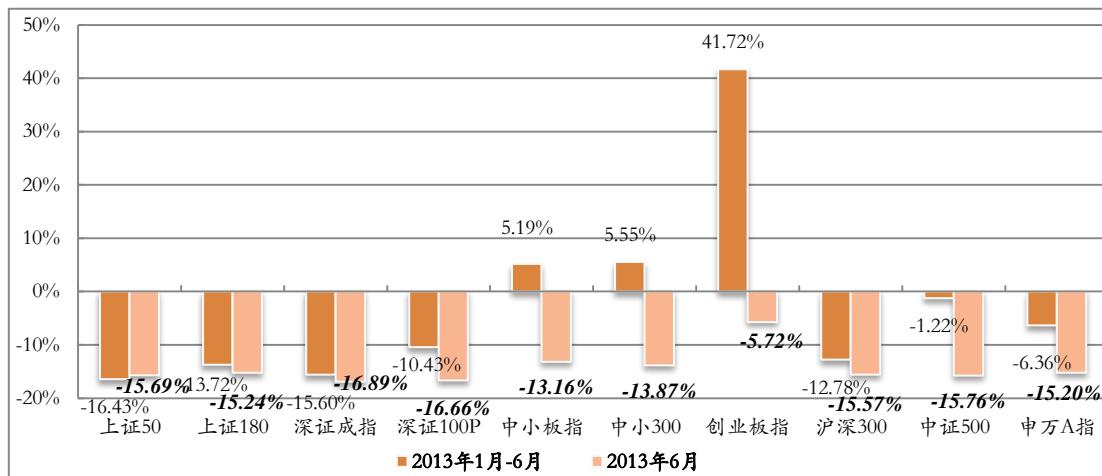


图 4 核心指数本月绝对收益

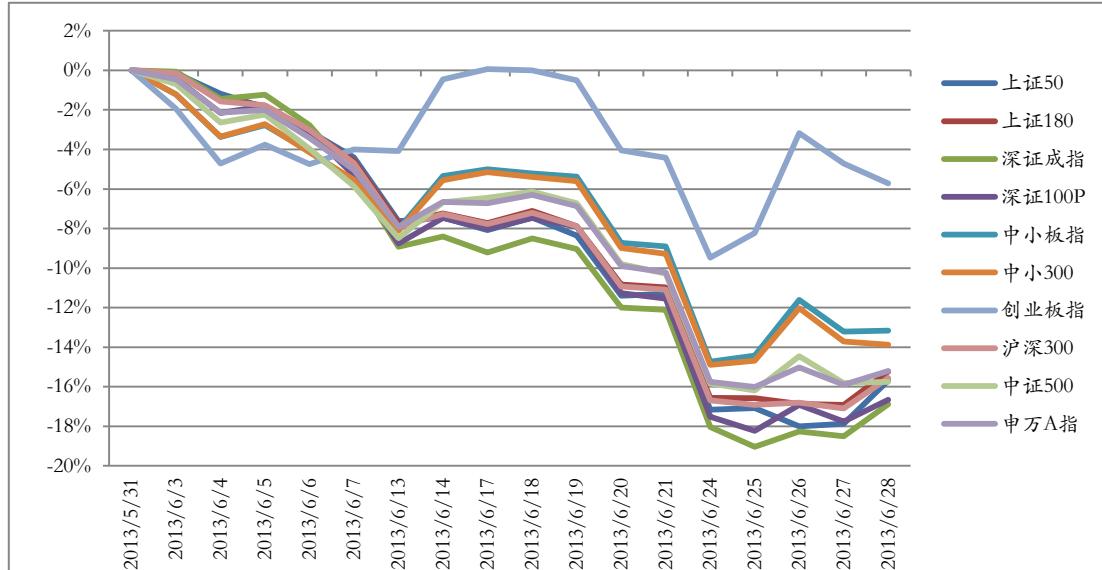
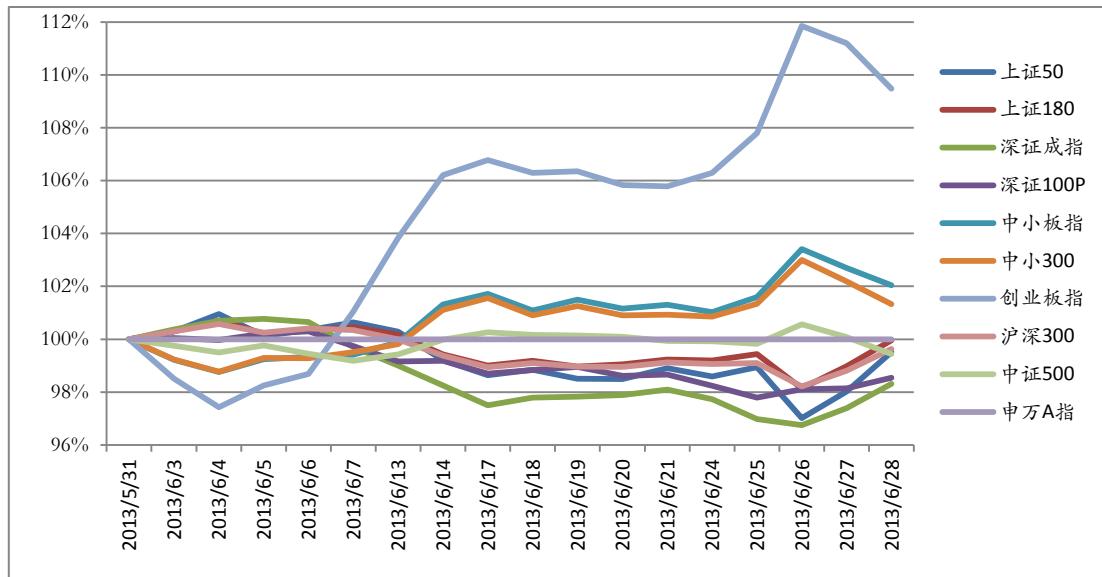


图 5 核心指数本月超额收益对比



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

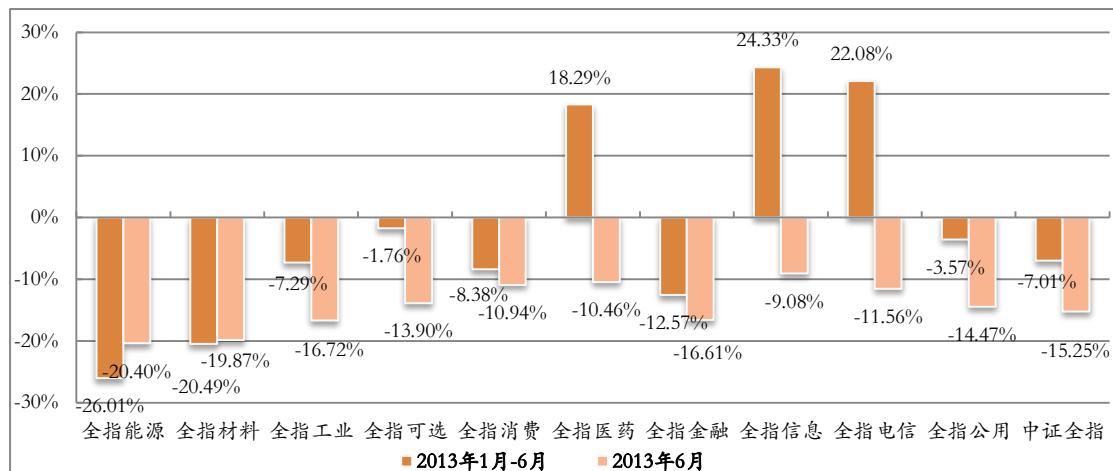


图 7 行业指数本月绝对收益

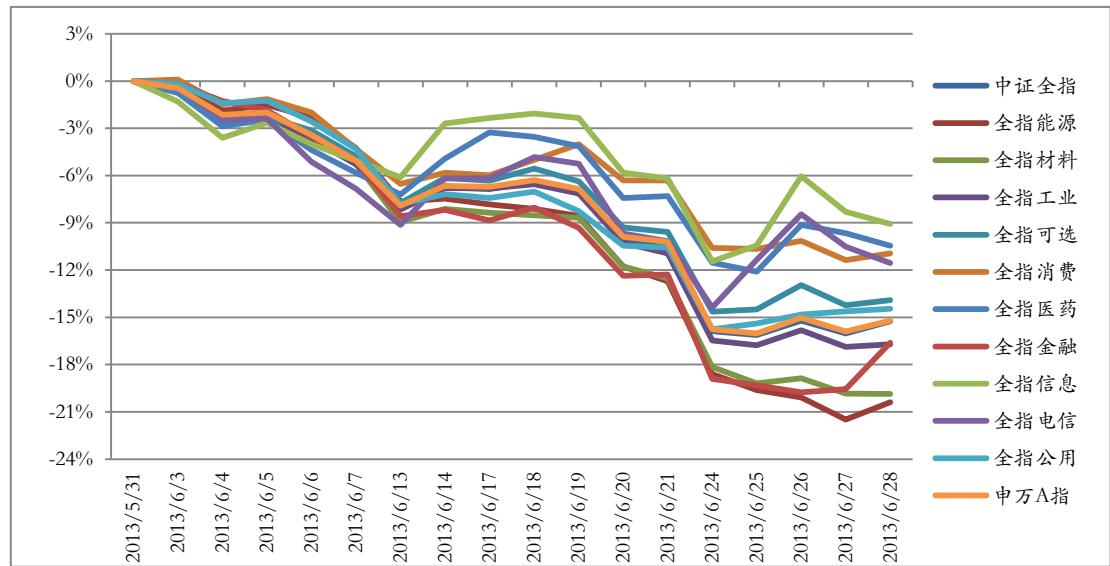
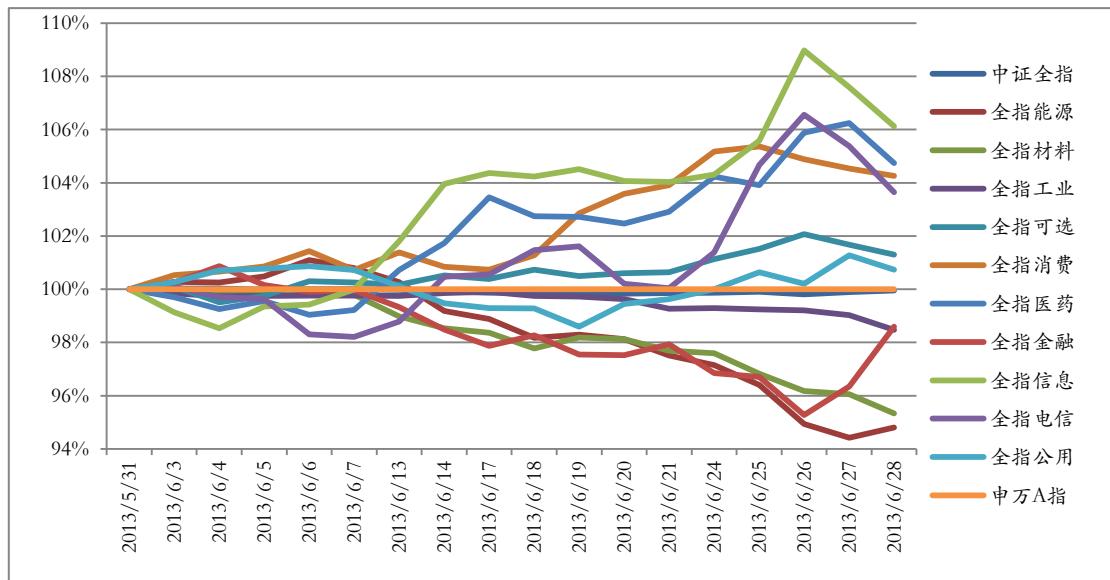


图 8 行业指数本月超额收益对比



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。