

广发基金指数月报

(2013年8月1日—2013年8月30日)

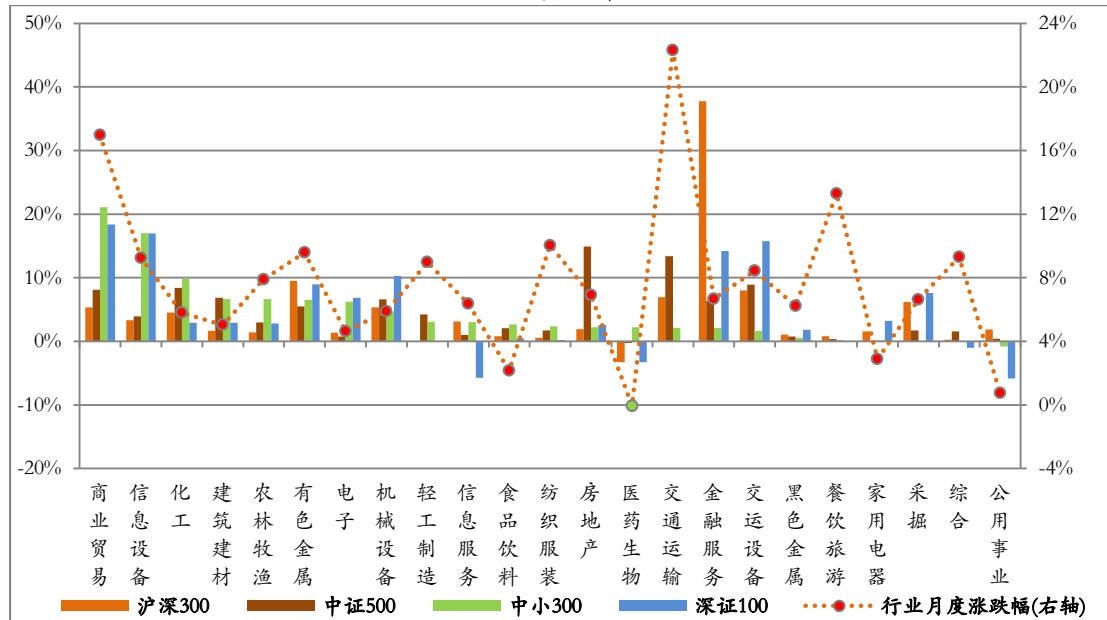
广发基金数量投资部

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

本月市场继续上涨，申万一级行业仅医药生物微跌0.05%，22个上涨行业中交通运输和商业贸易行业涨幅超过16%，公用事业行业上涨不到1%。从各指数成份股的行业贡献率来看，金融服务行业的上涨对沪深300指数影响最大，贡献率为37.8%；房地产行业上涨对中证500指数贡献最大，贡献率为14.9%；商业贸易行业上涨对深证100P指数贡献最大，贡献率达18.4%；商业贸易行业上涨对中小300贡献居首，贡献率为21.1%。

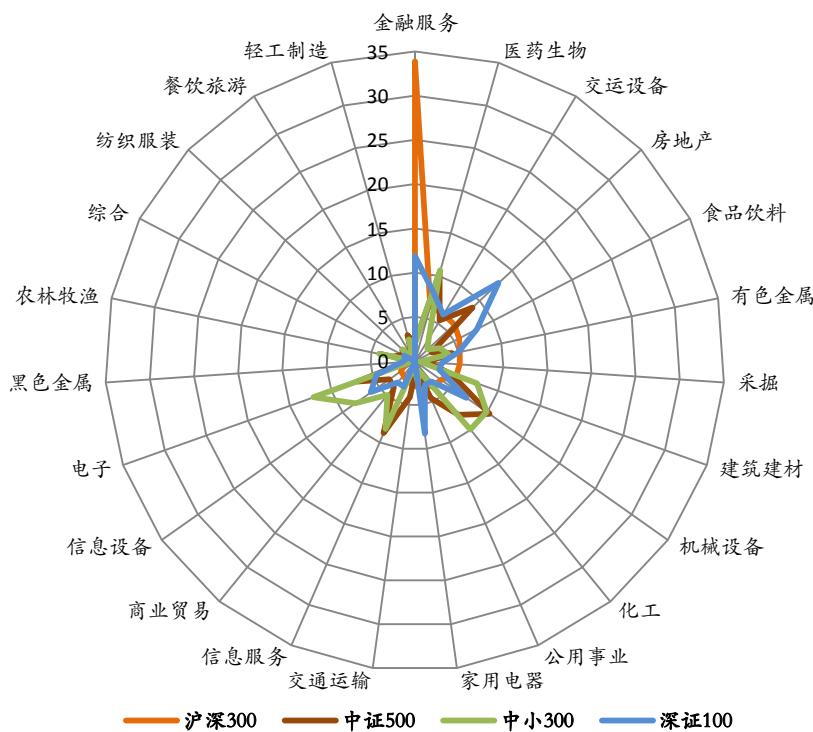
图1 成份行业贡献率与月度涨跌幅



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33.9%。医药生物、机械设备和房地产行业在中证500指数中权重居前，依次为10.3%、10.3%和8.90%。房地产、金融和家用电器行业在深证100P指数中权重位列前三，依次为12.9%、11.9%和8.26%。电子、医药生物

和化工行业在中小 300 指数中权重居前，分别为 12.1%、10.7% 和 9.96%。

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 0.32%，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 1% 以内，取得了优异的跟踪效果。

表 1 基金净值与跟踪误差

基金简称	2013 年 8 月		2013 年 7 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	0.8260	0.8260	0.7760	0.7760	0.9328	2009-11-26
广发沪深 300	1.0310	1.3210	0.9800	1.2700	0.8501	2008-12-30
广发中小板 300ETF	0.9084	0.8253	0.8651	0.7860	0.3235	2011-06-03
广发中小板 300ETF 联接	0.8286	0.8286	0.7911	0.7911	0.3173	2011-06-09
广发深证 100 分级	0.8543	0.8772	0.8197	0.8426	0.6574	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

8月沪深两市普涨，覆盖两市的申万A指上涨6.50%。指数方面，本期核心市场指数中，中证500表现最好，涨幅为6.8%，深证100表现较差，上涨4.38%。

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	1504.17	1513.80	1711.43	1508.81	1589.78	5.69%	4820.17
上证180	4749.84	4777.65	5330.24	4765.71	5013.33	5.55%	9491.55
深证成指	7765.40	7819.45	8476.05	7789.93	8202.48	5.63%	2657.10
深证100P	2592.87	2610.66	2816.56	2603.48	2706.50	4.38%	5034.35
中小板指	4623.88	4635.31	5071.70	4630.05	4861.34	5.14%	3483.02
中小板300	864.10	866.04	946.51	865.63	908.27	5.11%	6806.73
创业板指	1134.02	1135.45	1253.40	1125.59	1185.15	4.51%	2375.42
沪深300	2193.02	2206.00	2423.08	2200.63	2313.91	5.51%	14741.35
中证500	3430.74	3435.08	3740.13	3429.72	3664.15	6.80%	10404.13
申万A指	1940.52	1947.79	2104.59	1945.23	2066.67	6.50%	44878.69

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	1938.28	1950.32	2186.02	1945.04	2043.70	5.44%	1216.95
全指材料	1942.89	1949.27	2155.25	1948.23	2094.01	7.78%	5427.86
全指工业	2125.36	2134.83	2316.54	2134.83	2290.33	7.76%	7684.56
全指可选	3034.30	3043.16	3356.48	3037.39	3285.96	8.29%	6088.22
全指消费	5237.70	5258.66	5649.48	5246.93	5451.28	4.08%	2278.96
全指医药	6349.07	6361.00	6767.66	6300.87	6325.28	-0.37%	2660.03
全指金融	3164.63	3183.59	3542.65	3172.68	3370.55	6.51%	5431.39
全指信息	2997.75	3000.14	3421.72	2997.74	3203.11	6.85%	7135.18
全指电信	3029.60	3028.70	3401.23	3023.55	3196.94	5.52%	1483.54
全指公用	1560.33	1568.54	1680.33	1561.06	1608.82	3.11%	912.78
中证全指	2632.49	2642.39	2858.74	2638.68	2799.24	6.33%	43830.68

图 3 核心指数月度表现

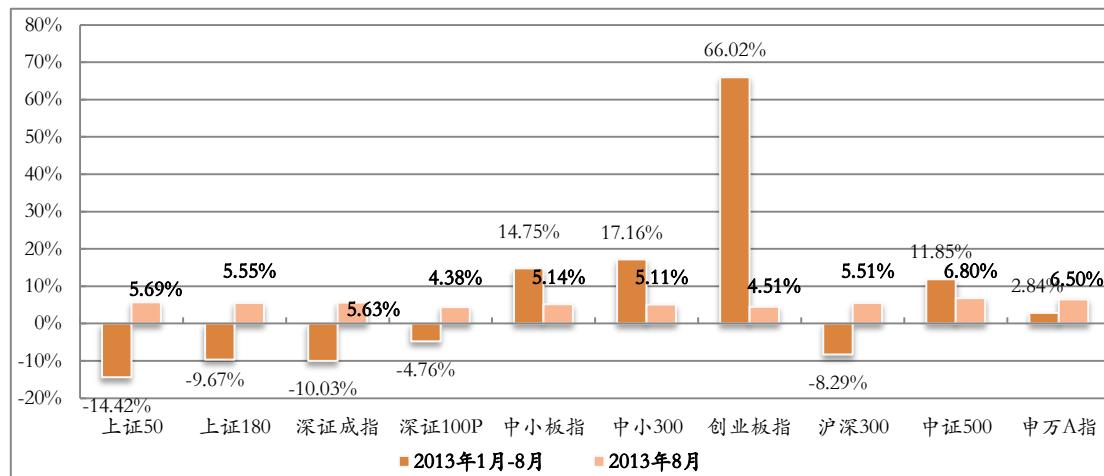


图 4 核心指数本月绝对收益

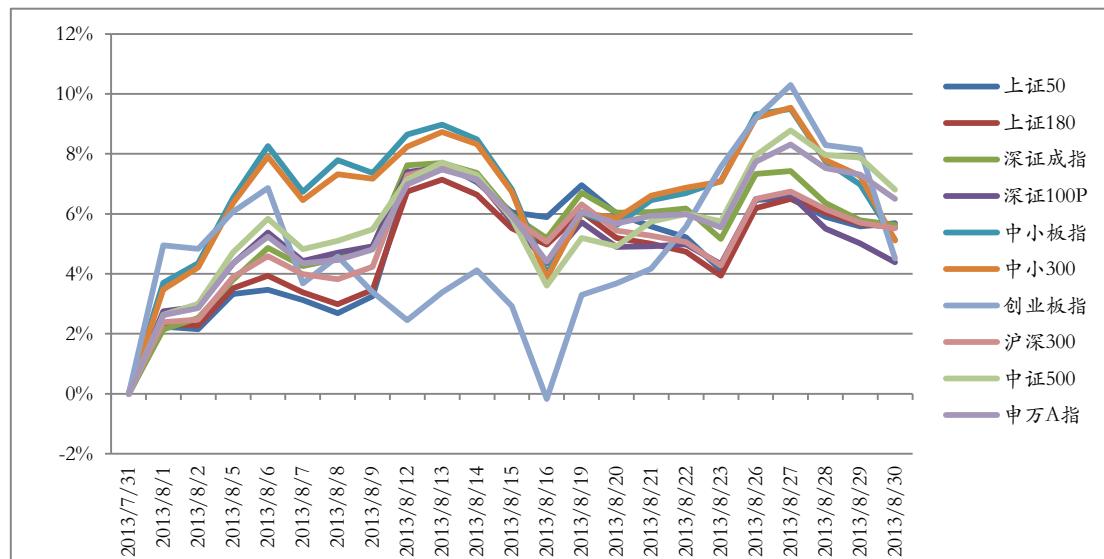
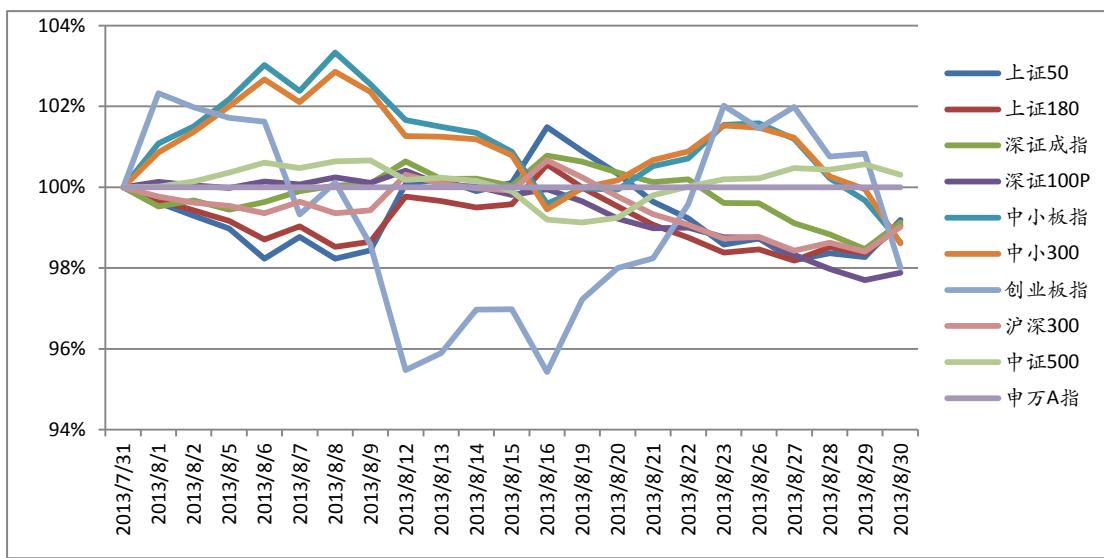


图 5 核心指数本月超额收益对比



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

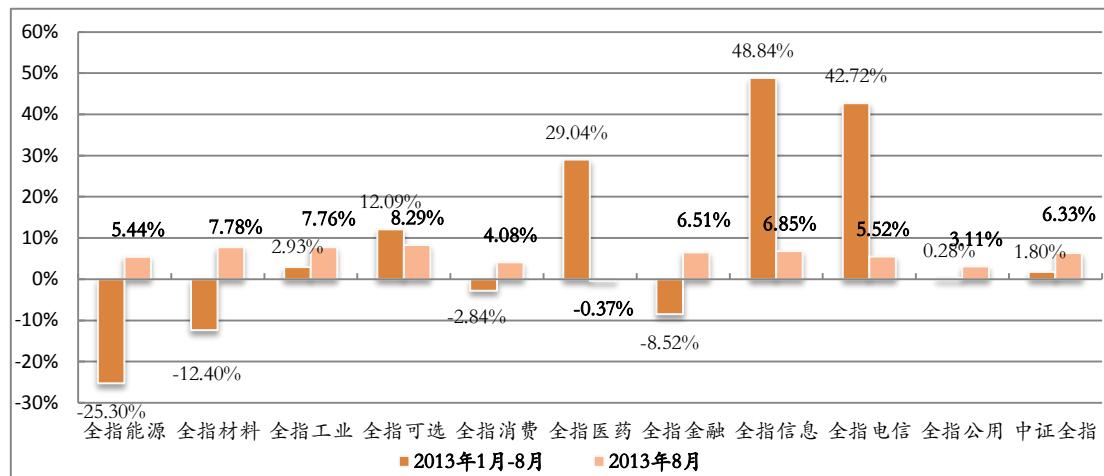


图 7 行业指数本月绝对收益

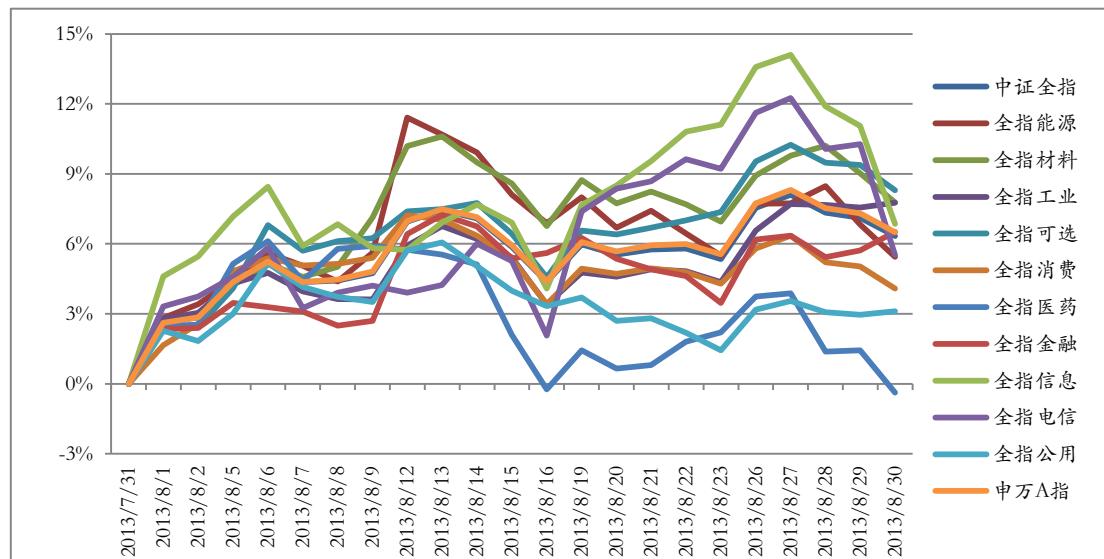
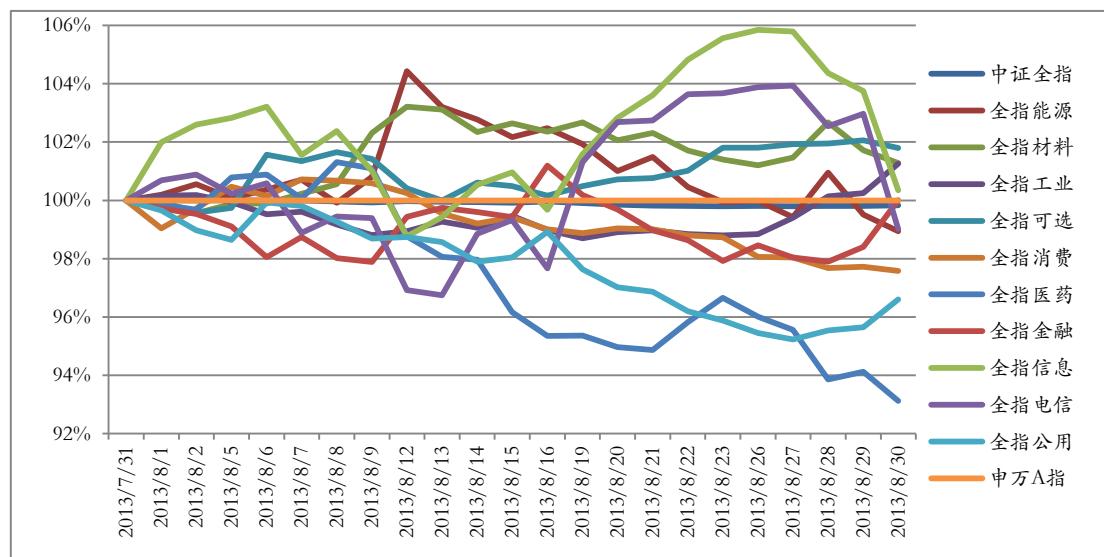


图 8 行业指数本月超额收益对比



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

8月份核心指数的估值水平较7月有所上升，市场平均动态（2013年）市盈率为10.07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7.27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	8.26	7.80	7.27	1.24
上证180	8.42	7.92	7.45	1.27
深证成指	13.92	13.11	12.13	2.08
深证100P	16.87	15.72	14.22	2.15
中小板指	28.31	26.42	23.24	3.64
中小板300	30.70	28.64	24.24	3.27
创业板指	54.63	50.48	38.92	4.99
沪深300	9.36	8.76	8.24	1.36
中证500	26.84	24.12	19.37	2.26
申万A指	12.27	11.37	10.07	1.61

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	10.77	10.73	10.14	1.28
全指材料	24.39	25.65	19.79	1.69
全指工业	16.96	16.46	13.49	1.67
全指可选	19.90	18.24	15.07	2.28
全指消费	19.54	17.96	16.11	3.33
全指医药	38.50	35.44	28.97	4.34
全指金融	7.08	6.53	6.15	1.17
全指信息	50.05	44.88	34.35	4.04
全指电信	36.41	32.26	26.07	2.08
全指公用	15.44	11.54	10.34	1.53
中证全指	12.19	11.32	10.03	1.60

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	9.03	9.06	13.69	9.45
600036	招商银行	10.66	0.57	13.10	6.98
601166	兴业银行	10.62	17.22	29.23	5.62
601318	中国平安	34.86	8.66	16.51	5.41
600000	浦发银行	8.99	14.38	25.93	4.66
贡献前 5 名样本股					
代码	简称	收盘	涨跌幅%	换手率%	贡献点数
601166	兴业银行	10.62	17.22	29.23	13.12
600016	民生银行	9.03	9.06	13.69	12.47
600000	浦发银行	8.99	14.38	25.93	9.31
601318	中国平安	34.86	8.66	16.51	6.86
600837	海通证券	11.58	10.08	63.81	6.31
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
600111	包钢稀土	29.24	23.90	132.00	6.03
601166	兴业银行	10.62	17.22	29.23	13.12
600489	中金黄金	10.53	15.21	41.78	1.51
601699	潞安环能	12.85	15.14	82.18	1.14
600547	山东黄金	24.64	14.66	68.99	1.65
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
600518	康美药业	18.60	-8.73	37.96	-2.02
601788	光大证券	10.07	-8.04	63.12	-0.88
600383	金地集团	6.41	-5.46	32.13	-1.22
601857	中国石油	7.83	-3.09	9.43	-0.64
601901	方正证券	5.91	-0.84	57.46	-0.11

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	9.03	9.06	13.69	6.08
600036	招商银行	10.66	0.57	13.10	4.49
601166	兴业银行	10.62	17.22	29.23	3.62
601318	中国平安	34.86	8.66	16.51	3.48
600000	浦发银行	8.99	14.38	25.93	3.00
贡献前 5 名样本股					
代码	简称	收盘	涨跌幅%	换手率%	贡献点数
601166	兴业银行	10.62	17.22	29.23	26.64
600016	民生银行	9.03	9.06	13.69	25.32
600000	浦发银行	8.99	14.38	25.93	18.91
601318	中国平安	34.86	8.66	16.51	13.93
600837	海通证券	11.58	10.08	63.81	12.83
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
600663	陆家嘴	19.32	85.06	98.22	5.34
600643	爱建股份	9.78	53.77	85.13	4.01
600895	张江高科	7.95	47.19	65.68	2.94
600675	中华企业	6.56	32.79	65.37	2.58
600588	用友软件	12.70	25.99	181.22	1.86
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
601117	中国化学	8.08	-13.68	104.87	-3.78
600516	方大炭素	8.33	-10.81	55.45	-1.30
600779	水井坊	12.44	-9.00	42.67	-0.64
600518	康美药业	18.60	-8.73	37.96	-4.08
600702	沱牌舍得	16.49	-8.44	65.84	-0.53

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	9.46	-0.63	25.51	10.16
000651	格力电器	26.07	0.15	16.45	7.31
000001	平安银行	10.61	10.64	47.82	5.54
000776	广发证券	11.83	-0.08	24.23	4.32
000858	五粮液	19.37	2.22	29.55	4.31
贡献前 5 名样本股					
代码	简称	收盘	涨跌幅%	换手率%	贡献点数
002024	苏宁云商	8.00	41.34	96.32	99.85
002415	海康威视	24.21	22.52	32.80	47.25
000001	平安银行	10.61	10.64	47.82	43.65
002241	歌尔声学	41.00	17.51	45.22	43.49
000625	长安汽车	10.46	23.06	53.43	32.82
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
002024	苏宁云商	8.00	41.34	96.32	99.85
000625	长安汽车	10.46	23.06	53.43	32.82
002415	海康威视	24.21	22.52	32.80	47.25
002241	歌尔声学	41.00	17.51	45.22	43.49
000960	锡业股份	12.84	16.83	39.13	9.09
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
000895	双汇发展	36.98	-7.67	25.56	-19.77
000423	东阿阿胶	40.18	-3.61	28.09	-8.14
000069	华侨城 A	5.77	-3.03	22.49	-6.10
000869	张裕 A	31.29	-1.60	41.82	-0.60
000538	云南白药	103.00	-1.08	16.13	-3.13

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	9.46	-0.63	25.51	6.44
000651	格力电器	26.07	0.15	16.45	4.64
000001	平安银行	10.61	10.64	47.82	3.51
000776	广发证券	11.83	-0.08	24.23	2.74
000858	五粮液	19.37	2.22	29.55	2.73
贡献前 5 名样本股					
代码	简称	收盘	涨跌幅%	换手率%	贡献点数
002024	苏宁云商	8.00	41.34	96.32	20.89
002415	海康威视	24.21	22.52	32.80	9.89
000001	平安银行	10.61	10.64	47.82	9.14
002241	歌尔声学	41.00	17.51	45.22	9.10
000625	长安汽车	10.46	23.06	53.43	6.87
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
002024	苏宁云商	8.00	41.34	96.32	20.89
000933	神火股份	5.76	26.04	48.43	2.35
000625	长安汽车	10.46	23.06	53.43	6.87
002415	海康威视	24.21	22.52	32.80	9.89
002001	新和成	18.87	19.43	47.23	2.15
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
002230	科大讯飞	46.78	-13.53	111.70	-5.37
000999	华润三九	25.87	-11.83	35.18	-2.82
300070	碧水源	39.00	-11.30	32.87	-4.61
000826	桑德环境	33.18	-11.24	42.32	-3.20
000793	华闻传媒	13.25	-8.30	74.05	-2.50

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	8.00	41.34	96.32	5.57
002241	歌尔声学	41.00	17.51	45.22	4.76
002415	海康威视	24.21	22.52	32.80	4.19
002236	大华股份	43.40	14.45	38.00	3.54
002450	康得新	26.14	0.19	36.88	3.15
贡献前 5 名样本股					
代码	简称	收盘	涨跌幅%	换手率%	贡献点数
002024	苏宁云商	8.00	41.34	96.32	79.20
002415	海康威视	24.21	22.52	32.80	37.48
002241	歌尔声学	41.00	17.51	45.22	34.50
002236	大华股份	43.40	14.45	38.00	21.71
002570	贝因美	33.77	9.64	56.15	8.93
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
002024	苏宁云商	8.00	41.34	96.32	79.20
002415	海康威视	24.21	22.52	32.80	37.48
002601	佰利联	20.54	21.83	115.15	2.79
002064	华峰氨纶	11.06	21.82	124.44	5.73
002037	久联发展	12.02	21.78	61.37	3.32
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
002273	水晶光电	18.33	-19.61	79.50	-9.33
002405	四维图新	13.96	-14.57	168.96	-8.81
002230	科大讯飞	46.78	-13.53	111.70	-20.35
002168	深圳惠程	7.90	-12.80	91.65	-3.15
002005	德豪润达	8.49	-9.97	70.91	-5.53

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	8.00	41.34	96.32	3.31
002241	歌尔声学	41.00	17.51	45.22	2.83
002415	海康威视	24.21	22.52	32.80	2.49
002236	大华股份	43.40	14.45	38.00	2.10
002450	康得新	26.14	0.19	36.88	1.87
贡献前 5 名样本股					
代码	简称	收盘	涨跌幅%	换手率%	贡献点数
002024	苏宁云商	8.00	41.34	96.32	8.79
002415	海康威视	24.21	22.52	32.80	4.16
002241	歌尔声学	41.00	17.51	45.22	3.83
002236	大华股份	43.40	14.45	38.00	2.41
002148	北纬通信	51.74	39.09	178.26	1.06
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
002160	常铝股份	5.51	49.73	259.25	0.33
002118	紫鑫药业	10.63	44.23	111.10	0.72
002210	飞马国际	8.00	43.63	199.48	0.31
002024	苏宁云商	8.00	41.34	96.32	8.79
002148	北纬通信	51.74	39.09	178.26	1.06
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
002273	水晶光电	18.33	-19.61	79.50	-1.03
002319	乐通股份	8.35	-17.00	158.14	-0.29
002405	四维图新	13.96	-14.57	168.96	-0.98
002550	千红制药	29.41	-14.03	59.50	-0.40
002230	科大讯飞	46.78	-13.53	111.70	-2.26

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%
300027	华谊兄弟	45.13	12.83	117.50	5.26
300070	碧水源	39.00	-11.30	32.87	5.16
300058	蓝色光标	47.50	5.79	18.12	3.62
300024	机器人	46.19	0.63	71.93	3.24
300104	乐视网	31.84	15.57	99.66	3.23
贡献前 5 名样本股					
代码	简称	收盘	涨跌幅%	换手率%	贡献点数
300002	神州泰岳	27.88	44.16	45.22	8.36
300052	中青宝	63.98	69.89	287.47	7.11
300027	华谊兄弟	45.13	12.83	117.50	7.08
300104	乐视网	31.84	15.57	99.66	5.12
300133	华策影视	32.50	15.13	70.60	3.65
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	63.98	69.89	287.47	7.11
300002	神州泰岳	27.88	44.16	45.22	8.36
300006	莱美药业	29.00	27.66	90.65	2.08
300238	冠昊生物	23.88	25.95	143.51	1.20
300115	长盈精密	38.31	24.59	44.25	2.80
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
300187	永清环保	20.90	-14.62	165.16	-0.77
300055	万邦达	32.73	-14.52	50.54	-2.14
300016	北陆药业	7.67	-11.84	152.18	-0.43
300070	碧水源	39.00	-11.30	32.87	-7.79
300177	中海达	20.70	-9.57	120.61	-0.75

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	9.03	9.06	13.69	4.19
600036	招商银行	10.66	0.57	13.10	3.09
601166	兴业银行	10.62	17.22	29.23	2.49
601318	中国平安	34.86	8.66	16.51	2.40
600000	浦发银行	8.99	14.38	25.93	2.07
贡献前 5 名样本股					
代码	简称	收盘	涨跌幅%	换手率%	贡献点数
601166	兴业银行	10.62	17.22	29.23	8.48
600016	民生银行	9.03	9.06	13.69	8.06
600000	浦发银行	8.99	14.38	25.93	6.01
002024	苏宁云商	8.00	41.34	96.32	4.93
601318	中国平安	34.86	8.66	16.51	4.44
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
600895	张江高科	7.95	47.19	65.68	0.95
002024	苏宁云商	8.00	41.34	96.32	4.93
600009	上海机场	15.95	33.20	44.94	1.83
601018	宁波港	2.65	30.54	30.48	1.13
600403	大有能源	9.34	27.94	91.40	0.47
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
601117	中国化学	8.08	-13.68	104.87	-1.20
000999	华润三九	25.87	-11.83	35.18	-0.65
600516	方大炭素	8.33	-10.81	55.45	-0.42
601991	大唐发电	4.60	-9.32	10.18	-0.67
600779	水井坊	12.44	-9.00	42.67	-0.21

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	46.78	-13.53	111.70	0.89
000503	海虹控股	18.23	-4.20	59.07	0.76
000793	华闻传媒	13.25	-8.30	74.05	0.74
000400	许继电气	31.25	16.26	54.43	0.72
000661	长春高新	113.50	6.44	30.72	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
600643	爱建股份	9.78	53.77	85.13	5.64
600717	天津港	7.59	48.24	45.30	4.40
600639	浦东金桥	14.16	104.42	176.93	4.13
000616	亿城股份	4.00	45.45	124.35	3.81
600675	中华企业	6.56	32.79	65.37	3.77
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
600639	浦东金桥	14.16	104.42	176.93	4.13
600575	芜湖港	3.80	61.02	75.62	2.98
600643	爱建股份	9.78	53.77	85.13	5.64
600717	天津港	7.59	48.24	45.30	4.40
000616	亿城股份	4.00	45.45	124.35	3.81
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
600251	冠农股份	16.42	-27.15	255.94	-2.36
002273	水晶光电	18.33	-19.61	79.50	-2.52
002405	四维图新	13.96	-14.57	168.96	-2.43
002230	科大讯飞	46.78	-13.53	111.70	-5.12
002168	深圳惠程	7.90	-12.80	91.65	-0.93

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	9.03	9.06	13.69	2.28
601318	中国平安	34.86	8.66	16.51	1.75
600036	招商银行	10.66	0.57	13.10	1.25
601166	兴业银行	10.62	17.22	29.23	1.24
600000	浦发银行	8.99	14.38	25.93	1.09
贡献前 5 名样本股					
代码	简称	收盘	涨跌幅%	换手率%	贡献点数
600016	民生银行	9.03	9.06	13.69	3.93
601166	兴业银行	10.62	17.22	29.23	3.79
601318	中国平安	34.86	8.66	16.51	2.90
600000	浦发银行	8.99	14.38	25.93	2.84
002024	苏宁云商	8.00	41.34	96.32	2.33
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
002071	江苏宏宝	19.03	215.59	117.70	0.31
600822	上海物贸	14.51	167.71	397.50	0.36
603128	华贸物流	12.54	139.77	282.77	0.19
000555	*ST 太光	22.16	117.26	96.71	0.21
600639	浦东金桥	14.16	104.42	176.93	0.39
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
600688	上海石化	4.20	-48.72	46.50	-0.12
600871	仪征化纤	4.35	-48.64	53.52	-0.04
600251	冠农股份	16.42	-27.15	255.94	-0.27
300241	瑞丰光电	11.82	-19.76	178.92	-0.06
002273	水晶光电	18.33	-19.61	79.50	-0.27

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。

风险提示及说明: 数据来源于中证指数有限公司、深证信息有限公司、申万研究。行业采用申万一级行业分类标准进行划分。指数过往涨幅不预示其未来表现, 也不代表跟踪该指数的指数基金的未来业绩。行业数据仅供参考, 不作为任何投资建议或收益暗示。