

广发基金指数月报

(2013年9月2日—2013年9月30日)

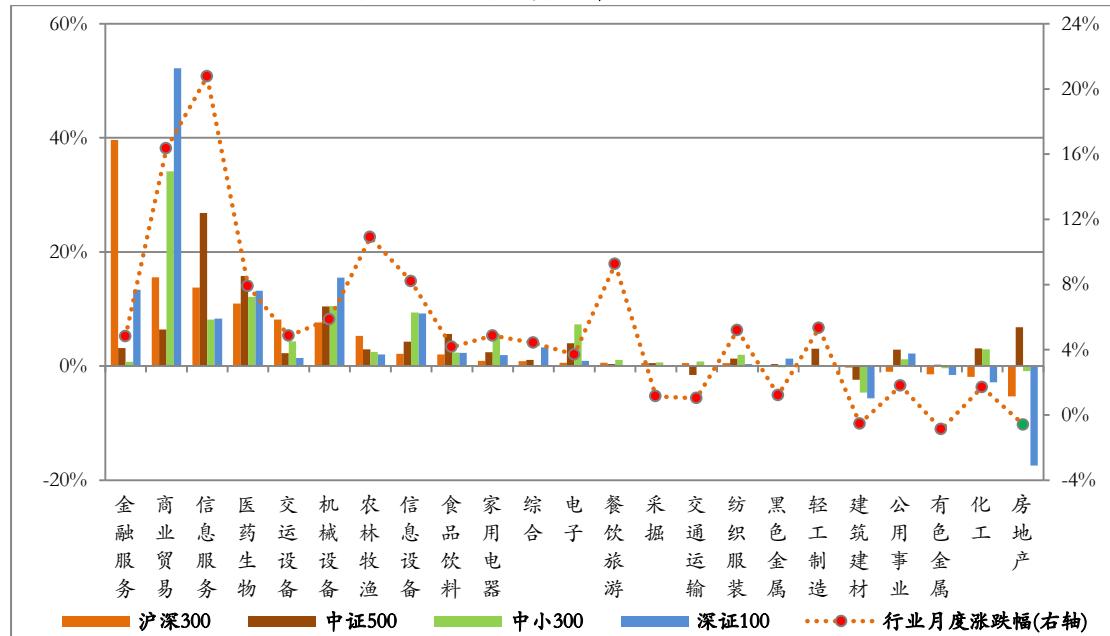
广发基金数量投资部

二、广发基金旗下指数基金运作

(一) 标的指数行业贡献及分布

本月市场持续上涨，申万一级行业有色金属、房地产和建筑建材行业小幅下跌 0.5%-0.9%，20 个上涨行业中信息服务和商业贸易行业涨幅超过 16%。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 39.6%；信息服务行业上涨对中证 500 指数贡献最大，贡献率为 26.9.9%；商业贸易行业上涨对深证 100P 指数贡献最大，贡献率达 52.2%；商业贸易行业上涨对中小 300 贡献居首，贡献率为 34.2%。

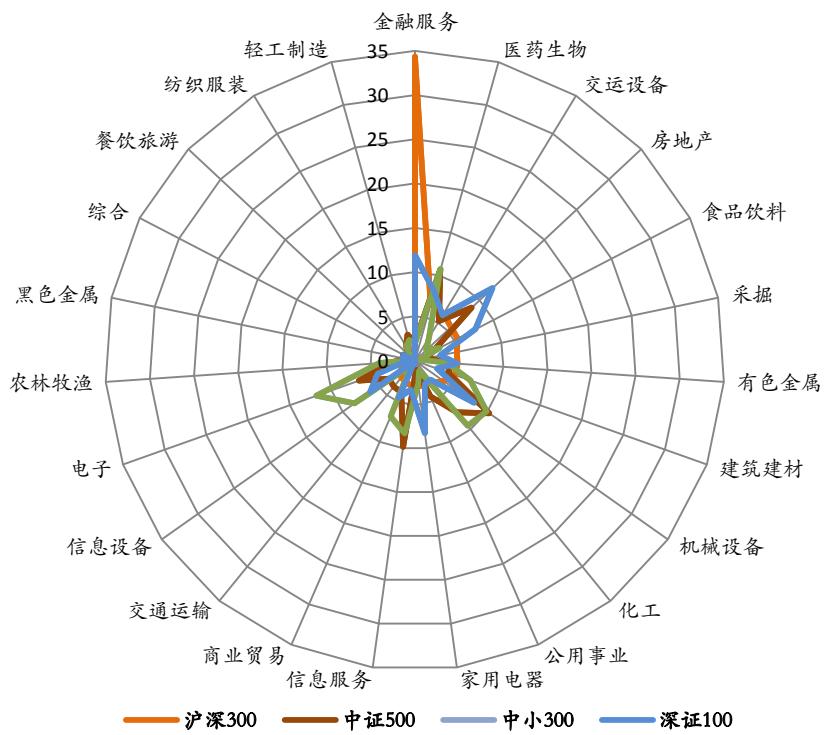
图 1 成份行业贡献率与月度涨跌幅



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34.4%。医药生物、机械设备和信息服务行业在中证500指数中权重居前,依次为10.6%、10.3%和9.83%。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 12.0%、11.9% 和 8.26%。电子、医药生物和机械设备行业在中小 300 指数中权重居前，分别为 11.8%、10.8% 和 9.95%。

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 0.30%，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 1.5% 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 9 月		2013 年 8 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	0.8700	0.8700	0.8260	0.8260	0.9826	2009-11-26
广发沪深 300	1.0720	1.3620	1.0310	1.3210	1.4331	2008-12-30
广发中小板 300ETF	0.9736	0.8846	0.9084	0.8253	0.3049	2011-06-03
广发中小板 300ETF 联接	0.8848	0.8848	0.8286	0.8286	0.3258	2011-06-09
广发深证 100 分级	0.8798	0.9027	0.8543	0.8772	0.7870	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

9月沪深两市普涨，覆盖两市的申万A指上涨5.17%。指数方面，本期核心市场指数中，创业板指表现最好，涨幅为15.4%，深证100表现较差，上涨3.13%。

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	1589.78	1594.99	1798.96	1579.72	1643.06	3.35%	6291.47
上证180	5013.33	5030.65	5546.85	4977.03	5213.53	3.99%	11890.80
深证成指	8202.48	8214.95	8766.70	8148.17	8514.57	3.80%	2874.52
深证100P	2706.50	2710.16	2858.62	2694.69	2791.21	3.13%	4797.83
中小板指	4861.34	4860.56	5294.86	4854.71	5234.51	7.68%	3084.70
中小板300	908.27	907.16	980.82	906.14	974.24	7.26%	5953.17
创业板指	1185.15	1179.32	1368.66	1178.01	1367.91	15.42%	2264.56
沪深300	2313.91	2319.96	2527.38	2297.45	2409.04	4.11%	17013.08
中证500	3664.15	3674.68	3930.60	3633.46	3872.89	5.70%	10782.66
申万A指	2066.67	2070.06	2206.77	2051.48	2173.47	5.17%	46451.72

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	2043.70	2045.75	2210.22	2026.39	2080.33	1.79%	976.52
全指材料	2094.01	2096.68	2218.30	2081.63	2113.08	0.91%	4412.42
全指工业	2290.33	2302.50	2474.40	2265.06	2379.34	3.89%	9410.92
全指可选	3285.96	3286.22	3756.29	3268.05	3721.69	13.26%	7661.06
全指消费	5451.28	5460.56	5770.02	5384.61	5761.56	5.69%	2886.57
全指医药	6325.28	6318.00	6814.41	6273.56	6805.82	7.60%	2240.07
全指金融	3370.55	3385.58	3861.34	3336.16	3479.53	3.23%	7790.07
全指信息	3203.11	3191.03	3457.84	3191.03	3457.46	7.94%	5064.77
全指电信	3196.94	3183.99	3466.26	3182.99	3410.64	6.68%	1129.27
全指公用	1608.82	1613.64	1689.39	1590.52	1627.69	1.17%	817.45
中证全指	2799.24	2804.23	2993.05	2777.85	2942.85	5.13%	45574.38

图 3 核心指数月度表现

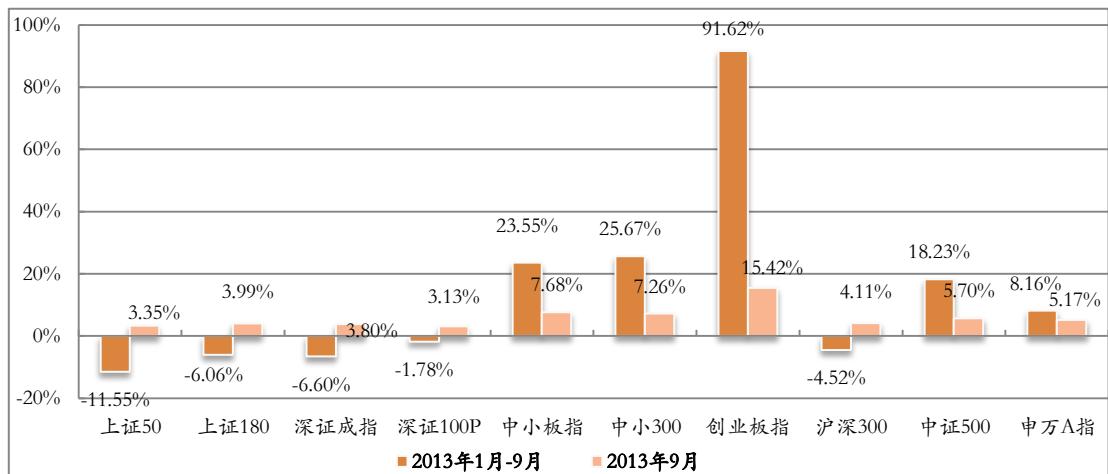


图 4 核心指数本月绝对收益

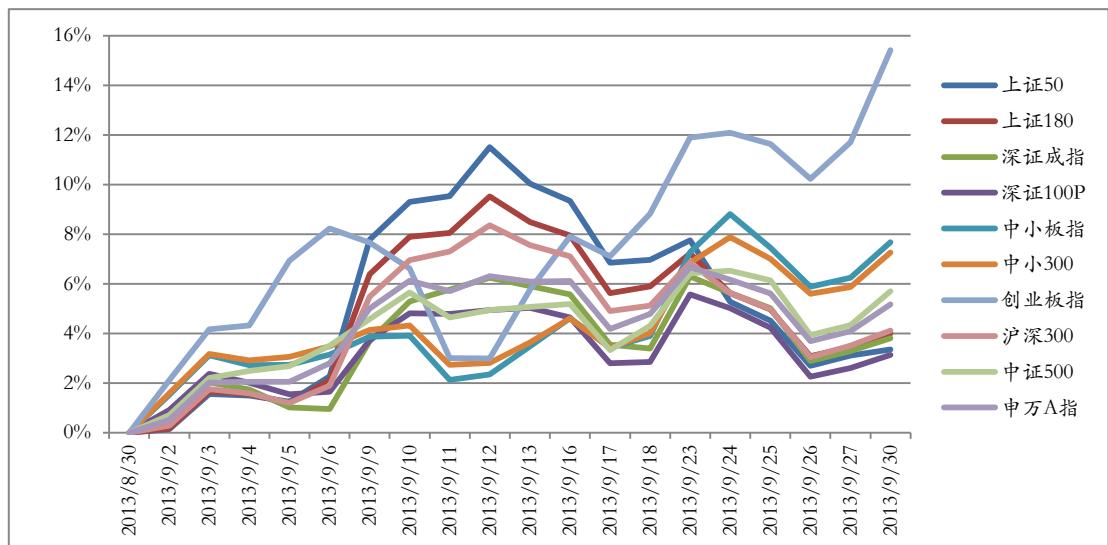
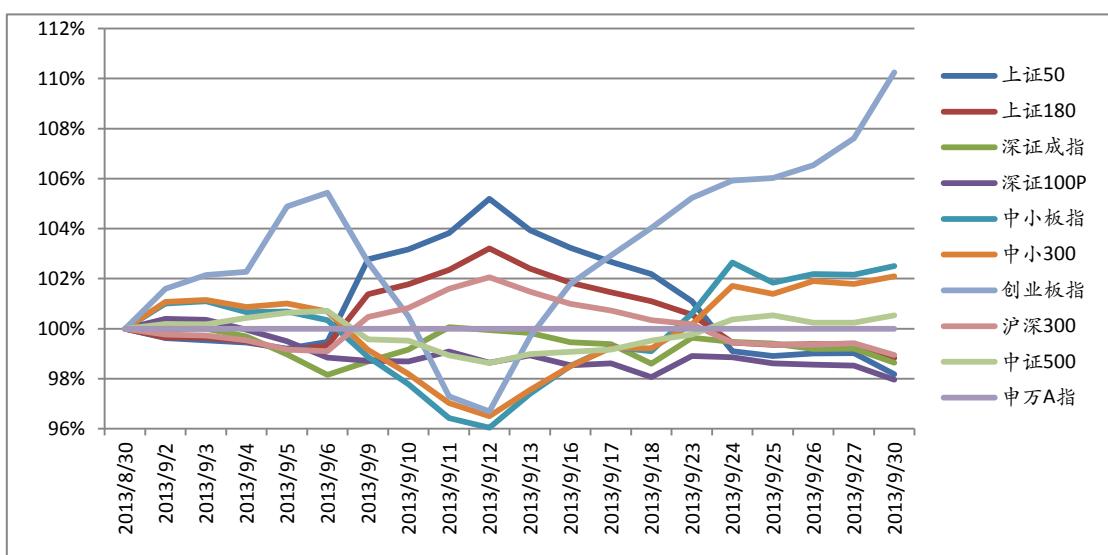


图 5 核心指数本月超额收益对比



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

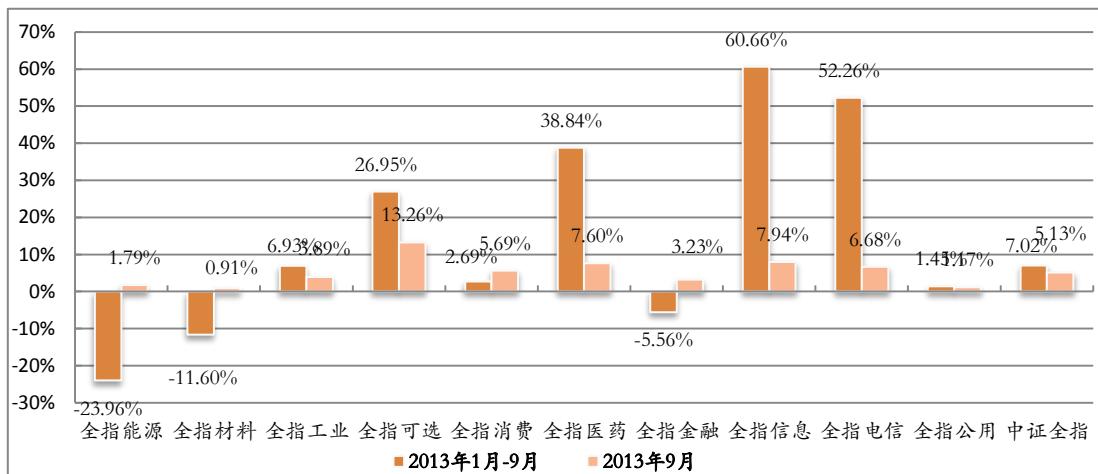


图 7 行业指数本月绝对收益

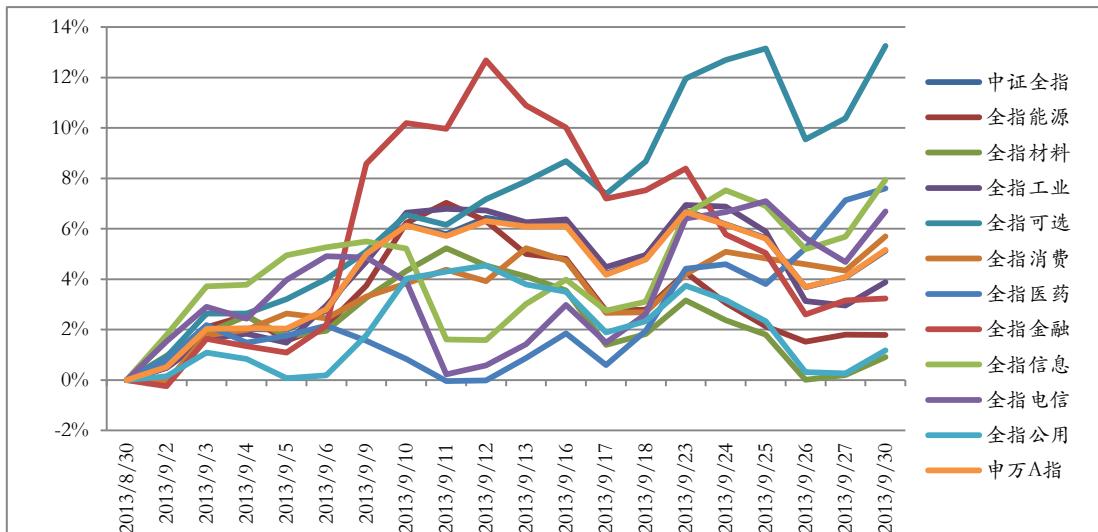
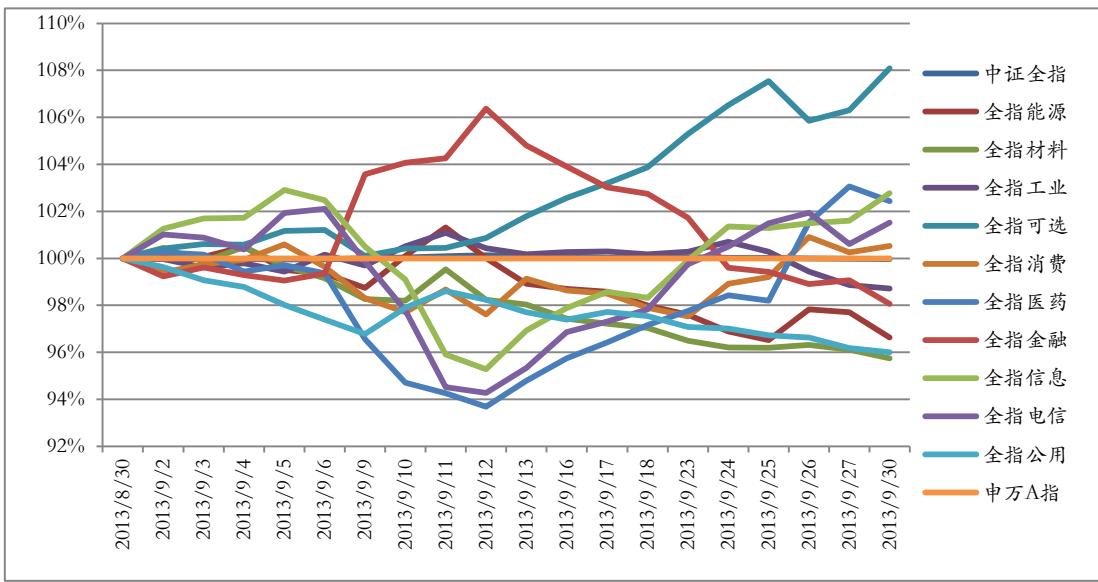


图 8 行业指数本月超额收益对比



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

9月份核心指数的估值水平较8月继续上升，市场平均动态（2013年）市盈率为10.5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7.46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	8.42	7.95	7.46	1.26
上证180	8.65	8.12	7.65	1.30
深证成指	14.75	13.87	12.76	2.21
深证100P	17.61	16.40	14.81	2.25
中小板指	30.45	28.45	25.15	3.91
中小板300	32.95	30.75	26.21	3.50
创业板指	65.13	58.97	45.83	6.09
沪深300	9.65	9.03	8.50	1.40
中证500	28.62	25.72	21.18	2.41
申万A指	12.81	11.87	10.50	1.68

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	10.85	10.80	10.27	1.31
全指材料	24.59	25.97	20.79	1.72
全指工业	17.77	17.28	14.55	1.74
全指可选	22.99	21.00	17.14	2.64
全指消费	20.36	18.52	16.86	3.43
全指医药	41.67	37.96	31.23	4.73
全指金融	7.26	6.69	6.29	1.19
全指信息	53.89	48.22	37.23	4.36
全指电信	38.59	34.42	27.32	2.19
全指公用	15.50	11.58	10.22	1.53
中证全指	12.74	11.82	10.47	1.67

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	9.56	7.56	19.07	9.58
600036	招商银行	10.92	4.40	13.82	8.00
601166	兴业银行	11.17	5.18	30.12	5.67
601318	中国平安	35.70	2.96	19.47	5.31
600000	浦发银行	10.09	12.24	88.01	5.01
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	9.56	7.56	19.07	11.41
600887	伊利股份	44.68	27.84	20.24	10.17
600000	浦发银行	10.09	12.24	88.01	8.98
600030	中信证券	12.29	11.42	41.11	6.33
600036	招商银行	10.92	4.40	13.82	5.60
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
601989	中国重工	6.10	36.77	115.48	5.26
600887	伊利股份	44.68	27.84	20.24	10.17
600000	浦发银行	10.09	12.24	88.01	8.98
600030	中信证券	12.29	11.42	41.11	6.33
601669	中国水电	3.11	9.51	49.08	0.76
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
600519	贵州茅台	135.94	-19.46	39.89	-10.00
600547	山东黄金	22.17	-10.02	46.26	-1.28
600489	中金黄金	9.76	-7.31	32.38	-0.83
600383	金地集团	6.02	-6.08	31.90	-1.26
601788	光大证券	9.52	-5.46	82.93	-0.56

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	9.56	7.56	19.07	6.15
600036	招商银行	10.92	4.40	13.82	5.13
601166	兴业银行	11.17	5.18	30.12	3.64
601318	中国平安	35.70	2.96	19.47	3.41
600000	浦发银行	10.09	12.24	88.01	3.22
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	9.56	7.56	19.07	23.19
600887	伊利股份	44.68	27.84	20.24	20.68
600000	浦发银行	10.09	12.24	88.01	18.26
600637	百视通	52.35	64.06	70.26	16.89
600030	中信证券	12.29	11.42	41.11	12.84
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
601118	海南橡胶	7.87	66.73	333.86	5.54
600637	百视通	52.35	64.06	70.26	16.89
600598	北大荒	11.84	58.93	200.41	4.65
603000	人民网	93.90	44.60	134.73	3.61
601989	中国重工	6.10	36.77	115.48	10.68
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
600315	上海家化	43.41	-22.16	29.98	-8.65
600519	贵州茅台	135.94	-19.46	39.89	-20.34
600809	山西汾酒	18.29	-18.28	70.97	-1.61
600199	金种子酒	11.02	-13.43	63.69	-0.98
600702	沱牌舍得	14.36	-12.92	63.53	-0.78

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	9.13	-3.49	25.68	9.41
000651	格力电器	26.56	1.88	17.34	7.15
002024	苏宁云商	12.85	60.62	113.70	6.42
000001	平安银行	11.88	11.97	47.72	5.95
000776	广发证券	11.85	0.17	22.57	4.16
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	12.85	60.62	113.70	206.63
000895	双汇发展	46.45	25.61	28.30	60.87
000001	平安银行	11.88	11.97	47.72	54.48
000538	云南白药	117.06	13.65	19.95	39.22
002415	海康威视	26.40	9.05	17.37	23.17
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	12.85	60.62	113.70	206.63
000895	双汇发展	46.45	25.61	28.30	60.87
000538	云南白药	117.06	13.65	19.95	39.22
000001	平安银行	11.88	11.97	47.72	54.48
002415	海康威视	26.40	9.05	17.37	23.17
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
000024	招商地产	24.00	-14.89	26.09	-31.43
002081	金螳螂	21.92	-12.63	28.98	-17.86
002304	洋河股份	43.41	-11.91	45.19	-15.26
000562	宏源证券	8.30	-10.75	136.34	-10.81
000858	五粮液	18.00	-7.07	28.62	-24.98

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	9.13	-3.49	25.68	6.02
000651	格力电器	26.56	1.88	17.34	4.57
002024	苏宁云商	12.85	60.62	113.70	4.10
000001	平安银行	11.88	11.97	47.72	3.80
000776	广发证券	11.85	0.17	22.57	2.66
贡献前 5 名样本股					
代码	简称	收盘	涨跌幅%	换手率%	贡献点数
002024	苏宁云商	12.85	60.62	113.70	43.27
000895	双汇发展	46.45	25.61	28.30	12.75
000001	平安银行	11.88	11.97	47.72	11.39
000538	云南白药	117.06	13.65	19.95	8.22
000917	电广传媒	18.70	29.05	124.27	6.65
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
002024	苏宁云商	12.85	60.62	113.70	43.27
000917	电广传媒	18.70	29.05	124.27	6.65
000895	双汇发展	46.45	25.61	28.30	12.75
002202	金风科技	7.02	19.59	56.14	3.82
002001	新和成	21.82	15.63	46.20	2.07
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
000596	古井贡酒	18.16	-16.77	63.87	-0.94
000024	招商地产	24.00	-14.89	26.09	-6.58
002081	金螳螂	21.92	-12.63	28.98	-3.74
002304	洋河股份	43.41	-11.91	45.19	-3.20
000686	东北证券	15.45	-11.76	144.70	-1.15

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	12.85	60.62	113.70	8.31
002241	歌尔声学	42.28	3.12	35.41	4.56
002415	海康威视	26.40	9.05	17.37	4.25
002236	大华股份	45.58	5.02	19.86	3.45
002353	杰瑞股份	70.08	6.50	21.58	2.72
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	12.85	60.62	113.70	164.16
002570	贝因美	41.60	23.19	41.47	23.53
002594	比亚迪	39.36	23.89	90.99	20.65
002415	海康威视	26.40	9.05	17.37	18.45
002277	友阿股份	14.44	64.09	147.68	16.08
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
002277	友阿股份	14.44	64.09	147.68	16.08
002024	苏宁云商	12.85	60.62	113.70	164.16
002153	石基信息	38.00	36.20	37.63	8.90
002344	海宁皮城	21.70	31.51	67.62	15.90
002223	鱼跃医疗	25.56	28.90	57.40	9.99
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
002081	金螳螂	21.92	-12.63	28.98	-14.21
002304	洋河股份	43.41	-11.91	45.19	-12.13
002051	中工国际	23.15	-9.14	22.87	-3.59
002450	康得新	23.98	-8.26	31.06	-12.67
002048	宁波华翔	8.26	-7.71	38.50	-2.23

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	12.85	60.62	113.70	4.95
002241	歌尔声学	42.28	3.12	35.41	2.72
002415	海康威视	26.40	9.05	17.37	2.53
002236	大华股份	45.58	5.02	19.86	2.06
002353	杰瑞股份	70.08	6.50	21.58	1.62
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	12.85	60.62	113.70	18.21
002570	贝因美	41.60	23.19	41.47	2.61
002594	比亚迪	39.36	23.89	90.99	2.29
002429	兆驰股份	15.35	60.73	43.15	2.05
002415	海康威视	26.40	9.05	17.37	2.05
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
002556	辉隆股份	11.44	86.02	606.91	1.33
002277	友阿股份	14.44	64.09	147.68	1.78
002429	兆驰股份	15.35	60.73	43.15	2.05
002024	苏宁云商	12.85	60.62	113.70	18.21
002261	拓维信息	32.89	56.25	352.66	1.61
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
002234	民和股份	9.42	-14.29	60.70	-0.27
002259	升达林业	5.95	-14.02	112.56	-0.36
002081	金螳螂	21.92	-12.63	28.98	-1.58
002304	洋河股份	43.41	-11.91	45.19	-1.35
002325	洪涛股份	9.81	-10.41	35.60	-0.34

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	77.88	72.57	145.57	7.86
300070	碧水源	40.70	4.36	23.13	4.66
300058	蓝色光标	67.00	41.05	19.26	4.42
300104	乐视网	31.84	0.00	0.00	2.80
300002	神州泰岳	38.41	37.77	135.08	2.75
贡献前 5 名样本股					
代码	简称	收盘	涨跌幅%	换手率%	贡献点数
300027	华谊兄弟	77.88	72.57	145.57	45.19
300058	蓝色光标	67.00	41.05	19.26	17.62
300251	光线传媒	64.74	77.13	167.36	15.07
300002	神州泰岳	38.41	37.77	135.08	10.31
300059	东方财富	21.43	40.16	116.70	9.97
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
300251	光线传媒	64.74	77.13	167.36	15.07
300027	华谊兄弟	77.88	72.57	145.57	45.19
300096	易联众	25.95	59.01	70.77	3.41
300274	阳光电源	28.87	52.91	80.64	4.77
300291	华录百纳	57.96	46.03	161.97	3.87
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
300136	信维通信	20.27	-13.45	83.33	-0.85
300147	香雪制药	22.09	-7.96	26.38	-1.50
300128	锦富新材	10.35	-7.51	104.29	-0.38
300307	慈星股份	8.45	-6.84	41.44	-0.29
300198	纳川股份	14.74	-4.96	49.47	-0.28

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	9.56	7.56	19.07	4.24
600036	招商银行	10.92	4.40	13.82	3.54
601166	兴业银行	11.17	5.18	30.12	2.51
601318	中国平安	35.70	2.96	19.47	2.35
600000	浦发银行	10.09	12.24	88.01	2.22
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	12.85	60.62	113.70	10.18
600016	民生银行	9.56	7.56	19.07	7.38
600887	伊利股份	44.68	27.84	20.24	6.58
600000	浦发银行	10.09	12.24	88.01	5.83
600637	百视通	52.35	64.06	70.26	5.39
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
601118	海南橡胶	7.87	66.73	333.86	1.74
600637	百视通	52.35	64.06	70.26	5.39
002024	苏宁云商	12.85	60.62	113.70	10.18
600598	北大荒	11.84	58.93	200.41	1.48
600832	东方明珠	10.54	55.00	158.74	2.79
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
600315	上海家化	43.41	-22.16	29.98	-2.75
600519	贵州茅台	135.94	-19.46	39.89	-6.46
600809	山西汾酒	18.29	-18.28	70.97	-0.50
000596	古井贡酒	18.16	-16.77	63.87	-0.20
601018	宁波港	2.25	-15.09	35.99	-0.74

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	47.62	2.11	71.49	0.86
000503	海虹控股	20.30	11.36	46.64	0.80
000917	电广传媒	18.70	29.05	124.27	0.73
600880	博瑞传播	29.20	30.53	223.93	0.71
000400	许继电气	32.23	3.14	23.26	0.70
贡献前 5 名样本股					
代码	简称	收盘	涨跌幅%	换手率%	贡献点数
600648	外高桥	54.53	267.20	412.37	13.81
600880	博瑞传播	29.20	30.53	223.93	6.42
000917	电广传媒	18.70	29.05	124.27	6.37
002429	兆驰股份	15.35	60.73	43.15	5.27
600643	爱建股份	12.91	32.00	293.76	5.18
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
600869	远东电缆	8.09	-16.34	105.23	-1.01
601880	大连港	2.56	-14.38	92.35	-0.95
601000	唐山港	3.08	-12.99	50.56	-0.80
600702	沱牌舍得	14.36	-12.92	63.53	-1.08
600270	外运发展	7.86	-12.37	56.78	-0.86

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	9.56	7.56	19.07	2.27
601318	中国平安	35.70	2.96	19.47	1.69
600036	招商银行	10.92	4.40	13.82	1.57
601166	兴业银行	11.17	5.18	30.12	1.23
600000	浦发银行	10.09	12.24	88.01	1.15
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	12.85	60.62	113.70	4.78
600016	民生银行	9.56	7.56	19.07	3.58
600887	伊利股份	44.68	27.84	20.24	3.48
300027	华谊兄弟	77.88	72.57	145.57	3.10
600000	浦发银行	10.09	12.24	88.01	2.75
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
600648	外高桥	54.53	267.20	412.37	0.80
300148	天舟文化	41.82	96.89	354.39	0.27
300085	银之杰	26.05	94.40	150.31	0.14
300071	华谊嘉信	40.18	88.55	160.24	0.31
002556	辉隆股份	11.44	86.02	606.91	0.36
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
300111	向日葵	4.48	-26.24	313.81	-0.16
600751	天津海运	4.64	-24.80	285.67	-0.09
000573	粤宏远 A	4.34	-24.26	36.50	-0.18
600315	上海家化	43.41	-22.16	29.98	-1.34
600278	东方创业	9.92	-20.13	377.69	-0.09

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。