

# 广发基金指数月报

(2013年11月1日—2013年11月29日)

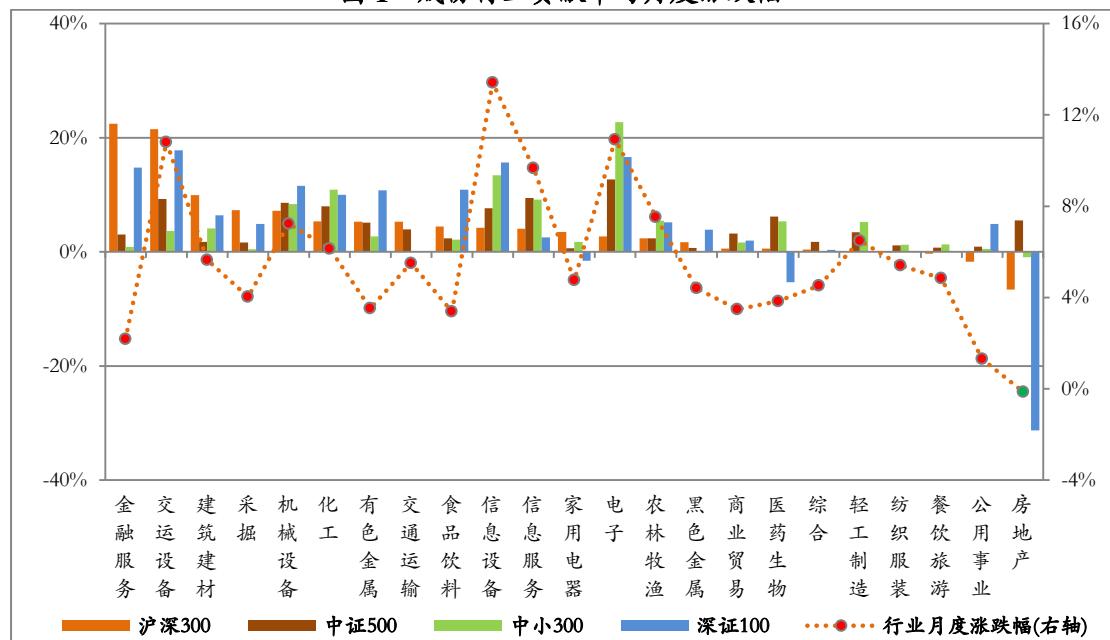
广发基金数量投资部

## 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

本月市场下跌，申万一级行业中仅房地产行业小幅下跌0.12%、其余22个申万一级行业均上涨，其中交运设备和信息设备行业上涨超10%。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22.5%；电子行业上涨对中证500、中证300指数贡献最大，贡献率分别为12.7%、22.7%；交运设备上涨对深证100P指数贡献最大，贡献率达17.8%。

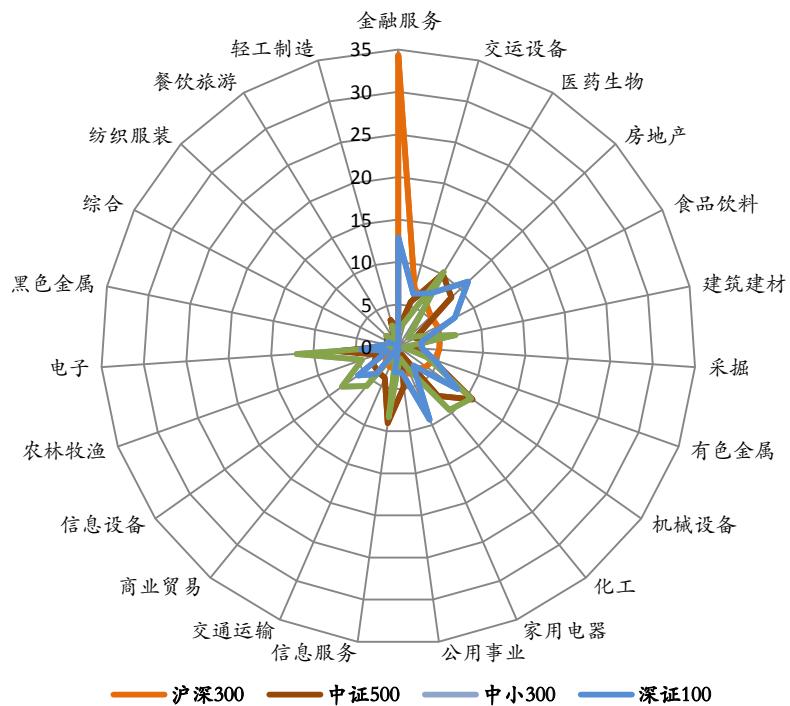
图1 成份行业贡献率与月度涨跌幅



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%。机械设备、医药生物和信息服务行业在中证500指数中权重居前，依次为10.7%、10.1%和9.05%。金融服务、房地产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%、11.3%和9.31%。电子、机

械设备和医药生物行业在中小 300 指数中权重居前，分别为 12.0%、10.5% 和 10.3%。

图 2 行业权重分布 (%)



## （二）基金运作情况分析

上月广发中证 500ETF 的年化跟踪误差为 0.14%，中证 500ETF 联接(LOF)、沪深 300 指数、中小板 300ETF、中小板 300ETF 联接和广发深证 100 分级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 11 月		2013 年 10 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 500ETF	1.1119	1.1119	1.0466	1.0466	0.1427	2013-04-11
广发中证 500 联接	0.8829	0.8829	0.8342	0.8342	0.2193	2009-11-26
广发沪深 300	1.3264	1.3740	1.0570	1.3470	1.0508	2008-12-30
广发中小板 300ETF	0.8906	0.8906	0.9218	0.8375	0.1829	2011-06-03
广发中小板 300 联接	0.8911	0.8911	0.8406	0.8406	0.1920	2011-06-09
广发深证 100 分级	0.9031	0.9032	0.8663	0.8892	0.5326	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

11月沪深两市均上涨，覆盖两市的申万A指上涨5.13%。指数方面，本期核心市场指数中，创业板指表现最好，上涨10.63%，深证成指表现最差，上涨1.16%。

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	1631.05	1633.03	1680.82	1559.57	1661.41	1.86%	4493.07
上证180	5127.42	5129.52	5343.23	4936.89	5295.08	3.27%	9250.11
深证成指	8444.41	8433.76	8630.38	8054.96	8542.61	1.16%	2207.74
深证100P	2747.41	2746.64	2829.89	2632.76	2804.41	2.07%	3670.18
中小板指	4889.05	4870.72	5141.05	4725.48	5121.59	4.76%	2601.40
中小板300	921.79	918.53	981.89	892.56	980.80	6.40%	5390.07
创业板指	1235.56	1227.69	1369.12	1191.18	1366.83	10.63%	2510.92
沪深300	2373.72	2373.96	2460.56	2279.01	2438.94	2.75%	13485.55
中证500	3713.83	3698.47	3947.91	3575.84	3946.38	6.26%	8447.74
申万A指	2113.86	2108.72	2227.32	2038.96	2222.32	5.13%	39750.59

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	2107.01	2104.56	2212.10	2070.47	2182.36	3.58%	1224.42
全指材料	2030.30	2028.23	2160.23	1969.18	2145.19	5.66%	3855.77
全指工业	2367.58	2363.13	2546.58	2292.25	2543.69	7.44%	8090.99
全指可选	3553.65	3542.22	3743.91	3382.59	3737.05	5.16%	5898.64
全指消费	5566.66	5519.73	5825.53	5391.72	5801.75	4.22%	2576.47
全指医药	6308.42	6282.53	6547.03	6002.62	6541.35	3.69%	1946.54
全指金融	3445.38	3450.14	3534.94	3254.74	3487.44	1.22%	5125.04
全指信息	3233.67	3217.08	3586.05	3124.35	3584.29	10.84%	4792.17
全指电信	3098.12	3099.02	3463.07	2954.45	3455.96	11.55%	1131.22
全指公用	1715.20	1710.85	1743.56	1633.67	1714.07	-0.07%	899.66
中证全指	<b>2865.65</b>	<b>2859.45</b>	<b>3016.51</b>	<b>2761.37</b>	<b>3008.75</b>	<b>4.99%</b>	<b>38976.21</b>

图 3 核心指数月度表现

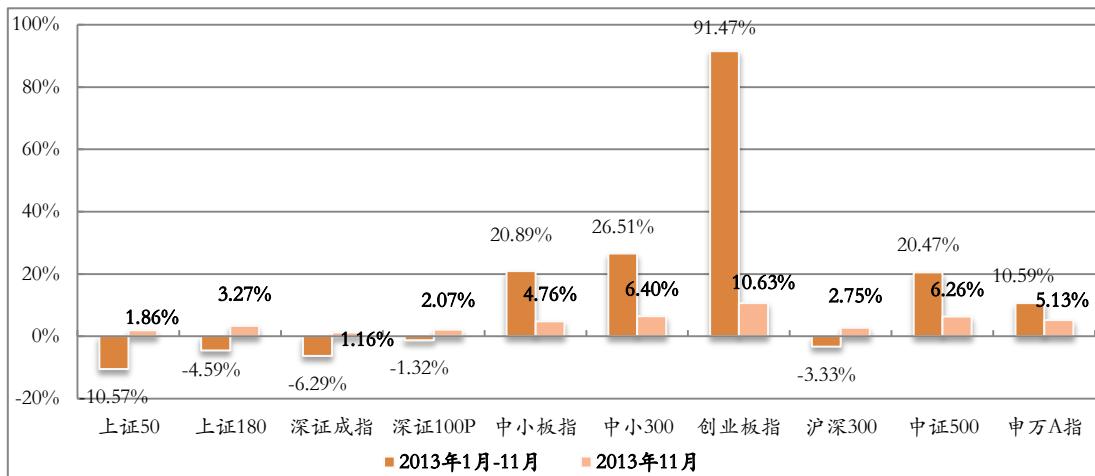


图 4 核心指数本月绝对收益

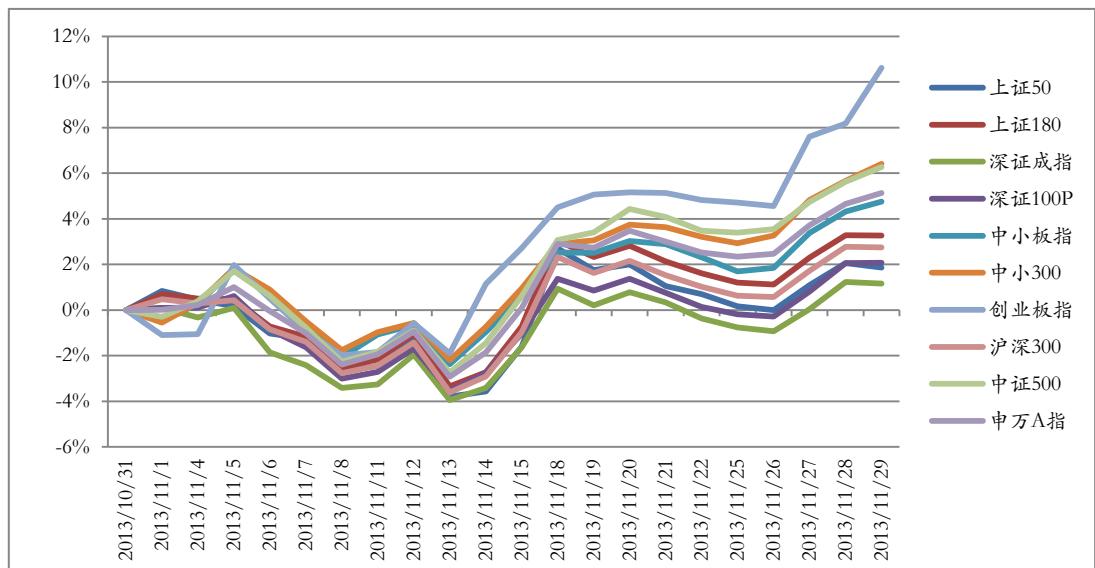
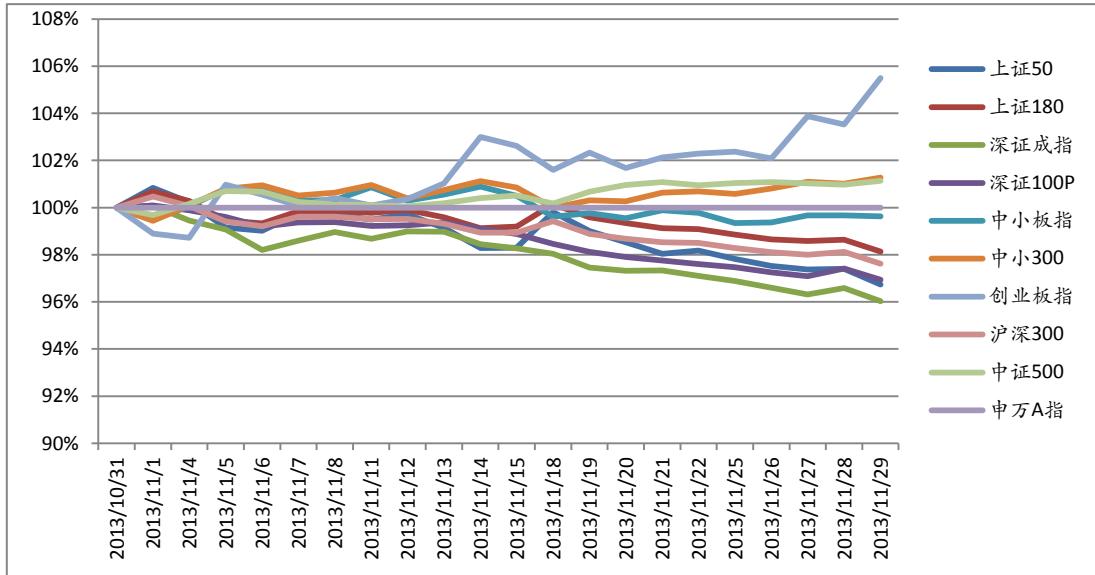


图 5 核心指数本月超额收益对比



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

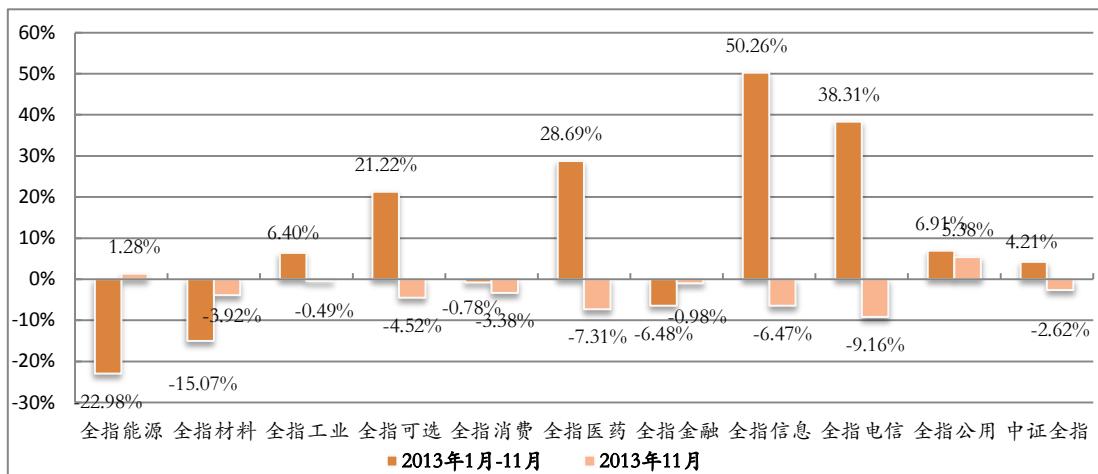


图 7 行业指数本月绝对收益

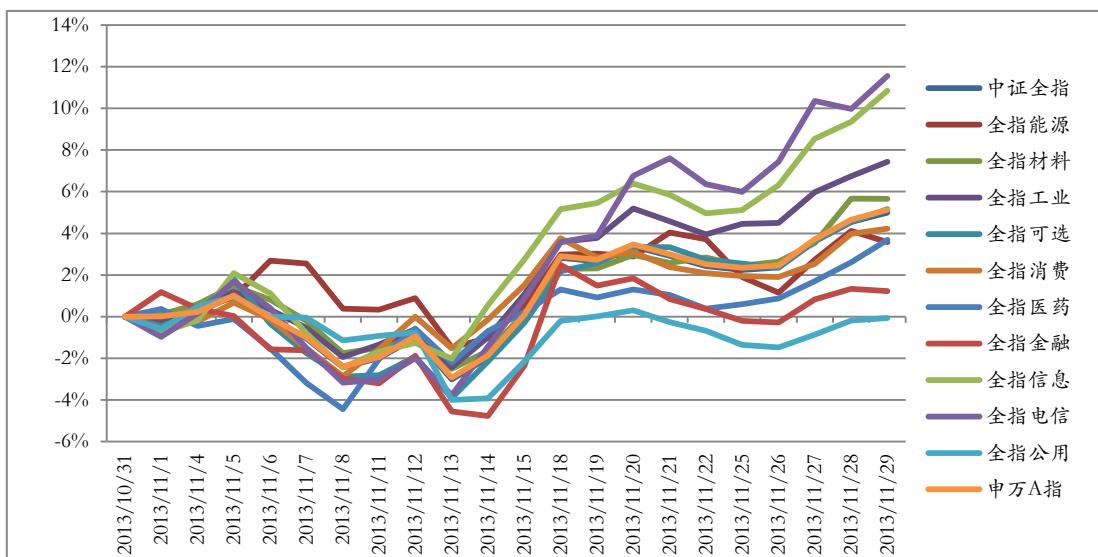
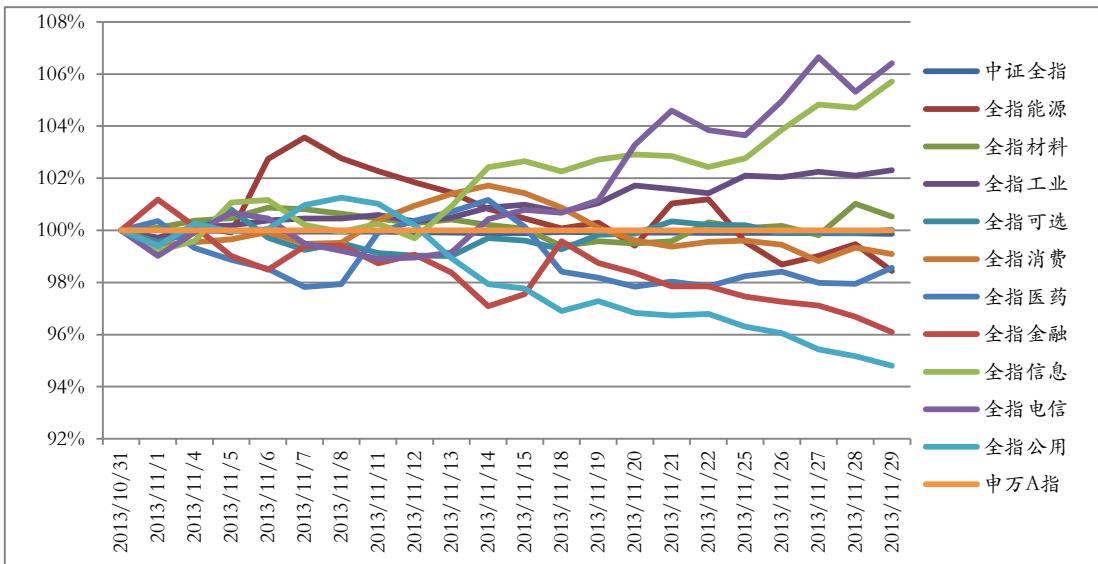


图 8 行业指数本月超额收益对比



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

11月份核心指数的估值水平较10月有所上升，市场平均动态（2013年）市盈率为10.8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7.66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	8.63	7.83	7.66	1.24
上证180	8.86	8.04	7.84	1.28
深证成指	14.72	13.69	12.84	2.10
深证100P	17.75	16.25	15.18	2.17
中小板指数	30.00	27.86	26.02	3.71
中小板300	33.35	30.68	27.49	3.44
创业板指P	65.52	57.33	47.77	5.91
沪深300	9.86	8.90	8.69	1.38
中证500	29.35	25.32	22.36	2.40
申万A指	13.17	11.73	10.82	1.66

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	11.23	11.20	11.00	1.32
全指材料	25.26	25.93	22.40	1.73
全指工业	19.02	17.83	15.91	1.80
全指可选	23.00	19.97	17.05	2.51
全指消费	20.62	19.32	17.68	3.36
全指医药	40.15	35.33	31.44	4.40
全指金融	7.38	6.53	6.35	1.16
全指信息	56.27	46.80	39.75	4.38
全指电信	39.71	35.25	28.91	2.20
全指公用	16.17	10.58	10.52	1.51
中证全指	<b>13.09</b>	<b>11.70</b>	<b>10.79</b>	<b>1.65</b>

## 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	8.59	-4.13	11.50	8.46
600036	招商银行	10.91	1.58	12.47	7.85
601318	中国平安	41.56	12.87	25.48	6.07
601166	兴业银行	10.70	-9.01	19.91	5.34
600000	浦发银行	9.99	-3.29	28.38	4.88
贡献前 5 名样本股					
代码	简称	收盘	涨跌幅%	换手率%	贡献点数
601318	中国平安	41.56	12.87	25.48	11.33
601601	中国太保	19.57	14.18	31.95	5.58
600030	中信证券	12.90	8.86	35.37	4.95
600585	海螺水泥	17.86	15.75	26.11	3.71
600104	上汽集团	15.38	7.25	31.28	2.87
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
600585	海螺水泥	17.86	15.75	26.11	3.71
601601	中国太保	19.57	14.18	31.95	5.58
601318	中国平安	41.56	12.87	25.48	11.33
601628	中国人寿	15.72	12.13	34.54	1.94
601766	中国南车	5.46	12.11	50.00	2.11
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
601166	兴业银行	10.70	-9.01	19.91	-7.62
600048	保利地产	8.90	-6.41	21.88	-1.77
600016	民生银行	8.59	-4.13	11.50	-6.22
600547	山东黄金	19.74	-3.99	23.18	-0.36
600256	广汇能源	11.31	-3.91	26.32	-0.82

## 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	8.59	-4.13	11.50	5.42
600036	招商银行	10.91	1.58	12.47	5.03
601318	中国平安	41.56	12.87	25.48	3.89
601166	兴业银行	10.70	-9.01	19.91	3.42
600000	浦发银行	9.99	-3.29	28.38	3.12
贡献前 5 名样本股					
代码	简称	收盘	涨跌幅%	换手率%	贡献点数
601318	中国平安	41.56	12.87	25.48	23.15
601601	中国太保	19.57	14.18	31.95	11.42
600030	中信证券	12.90	8.86	35.37	10.07
600585	海螺水泥	17.86	15.75	26.11	7.59
600104	上汽集团	15.38	7.25	31.28	5.88
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
600316	洪都航空	22.57	42.31	131.12	3.00
600372	中航电子	24.90	41.40	71.35	3.44
600118	中国卫星	20.75	36.96	171.20	4.50
600109	国金证券	16.89	35.99	122.33	2.52
600150	中国船舶	21.97	28.86	50.40	3.16
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
600240	华业地产	4.21	-17.13	37.06	-1.08
600340	华夏幸福	21.00	-10.64	20.83	-1.81
601166	兴业银行	10.70	-9.01	19.91	-15.55
600332	白云山	28.64	-7.07	56.93	-2.13
600415	小商品城	6.43	-6.81	37.49	-1.16

### 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	8.76	-4.89	16.52	9.00
000651	格力电器	31.20	1.30	17.26	8.37
000001	平安银行	13.60	-2.16	37.60	6.79
002024	苏宁云商	10.95	2.34	96.43	5.45
000776	广发证券	12.64	9.44	19.60	4.42
贡献前 5 名样本股					
代码	简称	收盘	涨跌幅%	换手率%	贡献点数
000776	广发证券	12.64	9.44	19.60	34.06
002241	歌尔声学	38.62	10.69	22.65	30.43
000063	中兴通讯	16.30	7.38	31.47	20.71
000338	潍柴动力	20.56	7.93	12.92	16.63
000768	中航飞机	10.74	18.67	48.43	15.90
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
000768	中航飞机	10.74	18.67	48.43	15.90
002081	金螳螂	23.06	10.81	18.36	9.58
002241	歌尔声学	38.62	10.69	22.65	30.43
000776	广发证券	12.64	9.44	19.60	34.06
000401	冀东水泥	9.48	8.84	37.92	3.28
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	21.93	-10.85	35.83	-18.82
000069	华侨城 A	5.45	-7.63	18.79	-14.52
000002	万科 A	8.76	-4.89	16.52	-45.64
000100	TCL 集团	2.36	-4.84	50.33	-7.78
000423	东阿阿胶	41.09	-4.11	18.27	-9.05

#### 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	8.76	-4.89	16.52	5.74
000651	格力电器	31.20	1.30	17.26	5.34
000001	平安银行	13.60	-2.16	37.60	4.33
002024	苏宁云商	10.95	2.34	96.43	3.48
000776	广发证券	12.64	9.44	19.60	2.82
贡献前 5 名样本股					
代码	简称	收盘	涨跌幅%	换手率%	贡献点数
000776	广发证券	12.64	9.44	19.60	7.13
002241	歌尔声学	38.62	10.69	22.65	6.37
000063	中兴通讯	16.30	7.38	31.47	4.34
002008	大族激光	12.81	22.47	77.97	3.98
000970	中科三环	14.20	14.06	67.77	3.83
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
002008	大族激光	12.81	22.47	77.97	3.98
000768	中航飞机	10.74	18.67	48.43	3.33
000550	江铃汽车	21.99	18.23	36.04	1.40
000596	古井贡酒	21.38	17.93	147.06	0.96
002041	登海种业	36.00	15.38	47.97	1.20
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	21.93	-10.85	35.83	-3.94
000069	华侨城 A	5.45	-7.63	18.79	-3.04
000800	一汽轿车	12.39	-6.56	37.90	-1.31
000400	许继电气	30.80	-5.69	23.47	-1.97
002244	滨江集团	7.49	-5.67	35.71	-0.37

## 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%
中小板指	002024	苏宁云商	10.95	2.34	96.43
中小板指	002241	歌尔声学	38.62	10.69	22.65
中小板指	002415	海康威视	24.72	3.52	14.82
中小板指	002236	大华股份	41.95	4.82	15.43
中小板指	002353	杰瑞股份	76.70	1.67	18.41
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	38.62	10.69	22.65	24.22
002008	大族激光	12.81	22.47	77.97	15.11
002450	康得新	25.51	9.48	21.82	12.91
002152	广电运通	17.15	28.46	33.97	11.39
002236	大华股份	41.95	4.82	15.43	9.82
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
002179	中航光电	18.45	37.58	113.05	6.44
002025	航天电器	14.74	29.30	100.36	4.18
002152	广电运通	17.15	28.46	33.97	11.39
002023	海特高新	18.92	24.47	71.11	5.14
002013	中航精机	16.10	24.42	84.35	4.03
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
002267	陕天然气	10.82	-6.48	73.03	-1.22
002244	滨江集团	7.49	-5.67	35.71	-1.42
002601	佰利联	20.32	-5.00	48.61	-0.73
002146	荣盛发展	11.16	-4.61	40.10	-2.15
002251	步步高	12.52	-4.43	47.94	-0.61

## 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	10.95	2.34	96.43	4.19
002241	歌尔声学	38.62	10.69	22.65	2.47
002415	海康威视	24.72	3.52	14.82	2.35
002236	大华股份	41.95	4.82	15.43	1.88
002353	杰瑞股份	76.70	1.67	18.41	1.76
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	38.62	10.69	22.65	2.69
002008	大族激光	12.81	22.47	77.97	1.68
002450	康得新	25.51	9.48	21.82	1.43
002049	同方国芯	55.68	34.82	82.08	1.28
002152	广电运通	17.15	28.46	33.97	1.26
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
002414	高德红外	22.66	64.32	168.84	1.05
002240	威华股份	7.70	61.43	1.23	0.69
002046	轴研科技	10.14	57.21	77.13	0.44
002268	卫士通	29.37	56.72	151.56	1.06
002170	芭田股份	6.58	42.12	162.39	0.31
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
002211	宏达新材	4.76	-15.30	42.25	-0.18
002482	广田股份	19.55	-11.14	41.27	-0.39
002094	青岛金王	7.88	-10.04	46.79	-0.20
002493	荣盛石化	8.48	-8.62	45.16	-0.09
002189	利达光电	7.16	-6.65	64.98	-0.06

## 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	31.62	35.19	196.70	6.24
300070	碧水源	45.00	7.14	17.75	5.04
300104	乐视网	42.95	16.93	87.87	3.70
300058	蓝色光标	54.10	5.97	16.49	3.50
300315	掌趣科技	37.52	16.45	231.04	2.81
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	31.62	35.19	196.70	19.25
300104	乐视网	42.95	16.93	87.87	5.88
300315	掌趣科技	37.52	16.45	231.04	5.35
300273	和佳股份	27.60	17.95	46.10	3.94
300070	碧水源	45.00	7.14	17.75	3.26
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
300045	华力创通	26.69	47.70	141.89	3.23
300113	顺网科技	58.52	43.43	107.42	2.60
300128	锦富新材	13.68	36.12	144.79	1.62
300027	华谊兄弟	31.62	35.19	196.70	19.25
300001	特锐德	25.97	34.70	63.57	1.37
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
300122	智飞生物	48.91	-12.08	17.45	-1.80
300175	朗源股份	4.57	-11.60	55.68	-0.51
300118	东方日升	8.17	-8.61	67.05	-0.91
300274	阳光电源	30.81	-7.97	44.29	-1.28
300090	盛运股份	32.80	-7.74	29.40	-1.41

## 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	8.59	-4.13	11.50	3.75
600036	招商银行	10.91	1.58	12.47	3.48
601318	中国平安	41.56	12.87	25.48	2.69
601166	兴业银行	10.70	-9.01	19.91	2.37
600000	浦发银行	9.99	-3.29	28.38	2.16
贡献前 5 名样本股					
代码	简称	收盘	涨跌幅%	换手率%	贡献点数
601318	中国平安	41.56	12.87	25.48	7.38
601601	中国太保	19.57	14.18	31.95	3.65
600030	中信证券	12.90	8.86	35.37	3.23
600585	海螺水泥	17.86	15.75	26.11	2.42
600104	上汽集团	15.38	7.25	31.28	1.87
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
600316	洪都航空	22.57	42.31	131.12	0.94
600372	中航电子	24.90	41.40	71.35	1.10
600118	中国卫星	20.75	36.96	171.20	1.44
600109	国金证券	16.89	35.99	122.33	0.79
600150	中国船舶	21.97	28.86	50.40	1.00
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
000703	恒逸石化	8.05	-11.25	57.58	-0.18
000024	招商地产	21.93	-10.85	35.83	-0.83
600403	大有能源	8.41	-10.82	36.33	-0.23
600340	华夏幸福	21.00	-10.64	20.83	-0.57
601166	兴业银行	10.70	-9.01	19.91	-4.96

## 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%
000503	海虹控股	23.70	21.35	37.54	0.92
002230	科大讯飞	46.78	7.29	31.39	0.83
000400	许继电气	30.80	-5.69	23.47	0.66
600388	龙净环保	35.08	5.28	121.05	0.65
000661	长春高新	110.85	13.98	24.49	0.63
贡献前 5 名样本股					
代码	简称	收盘	涨跌幅%	换手率%	贡献点数
000897	津滨发展	5.90	66.66	245.44	6.50
000503	海虹控股	23.70	21.35	37.54	5.10
600879	航天电子	10.40	34.37	121.46	4.73
002008	大族激光	12.81	22.47	77.97	3.73
002049	同方国芯	55.68	34.82	82.08	3.70
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
000897	津滨发展	5.90	66.66	245.44	6.50
002414	高德红外	22.66	64.32	168.84	2.64
600685	广船国际	16.82	51.12	88.08	1.92
600171	上海贝岭	10.16	41.51	96.13	2.92
600330	天通股份	8.28	40.10	142.68	2.06
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
600240	华业地产	4.21	-17.13	37.06	-1.56
600180	瑞茂通	9.22	-16.86	66.00	-1.02
600335	国机汽车	14.17	-12.91	40.35	-0.74
000732	泰禾集团	10.05	-11.61	20.27	-0.83
002482	广田股份	19.55	-11.14	41.27	-1.09

## 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	8.59	-4.13	11.50	1.98
601318	中国平安	41.56	12.87	25.48	1.91
600036	招商银行	10.91	1.58	12.47	1.52
601166	兴业银行	10.70	-9.01	19.91	1.15
600000	浦发银行	9.99	-3.29	28.38	1.10
贡献前 5 名样本股					
代码	简称	收盘	涨跌幅%	换手率%	贡献点数
601318	中国平安	41.56	12.87	25.48	4.78
600030	中信证券	12.90	8.86	35.37	1.81
601601	中国太保	19.57	14.18	31.95	1.39
300027	华谊兄弟	31.62	35.19	196.70	1.33
600585	海螺水泥	17.86	15.75	26.11	1.12
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
300304	云意电气	49.19	136.26	530.05	0.17
002681	奋达科技	71.80	130.13	330.57	0.32
002528	英飞拓	20.55	86.31	280.81	0.20
002373	联信永益	12.27	79.91	239.77	0.11
600855	航天长峰	17.28	74.37	312.38	0.37
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
600228	昌九生化	13.89	-49.95	3.46	-0.62
000537	广宇发展	6.28	-21.40	85.25	-0.16
002403	爱仕达	9.60	-19.33	68.68	-0.06
002071	江苏宏宝	16.15	-18.35	245.98	-0.08
600240	华业地产	4.21	-17.13	37.06	-0.17

## 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。