

广发基金指数月报

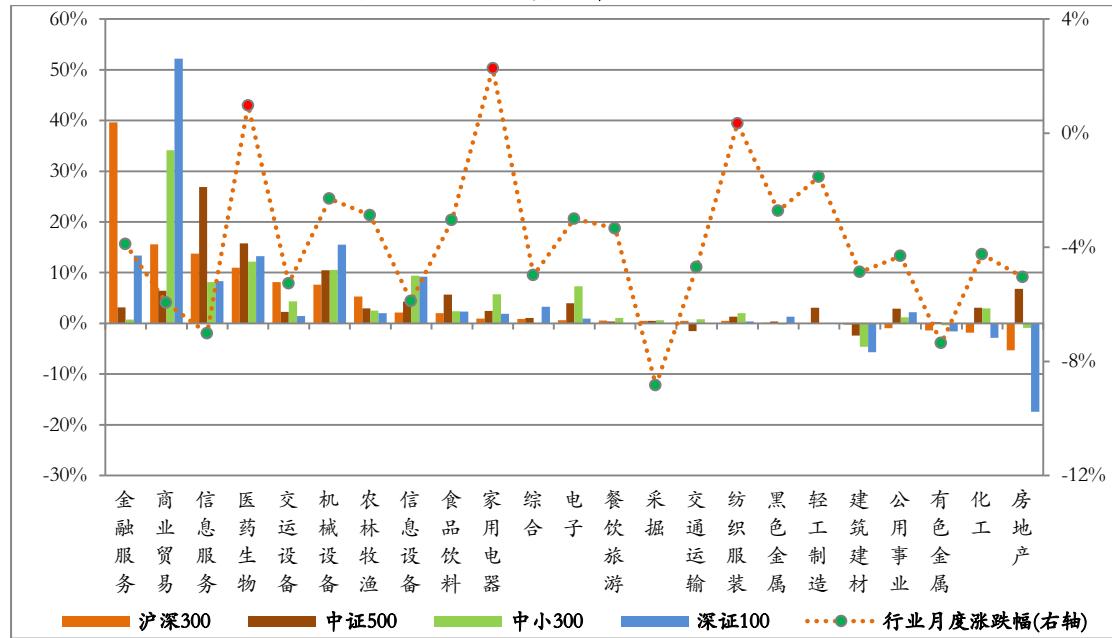
(2013年12月2日—2013年12月31日)
广发基金数量投资部

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，申万一级行业中仅家用电器、医药生物和纺织服装行业上涨0.35%~2.28%，其余20个申万一级行业均下跌，其中采掘行业跌幅达8.8%。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%；信息服务行业下跌对中证500指数贡献最大，贡献率为26.9%；商业贸易行业下跌对中小300指数贡献居首，贡献率为34.2%；商业贸易行业也对深证100指数贡献最大，贡献率高达52.2%。

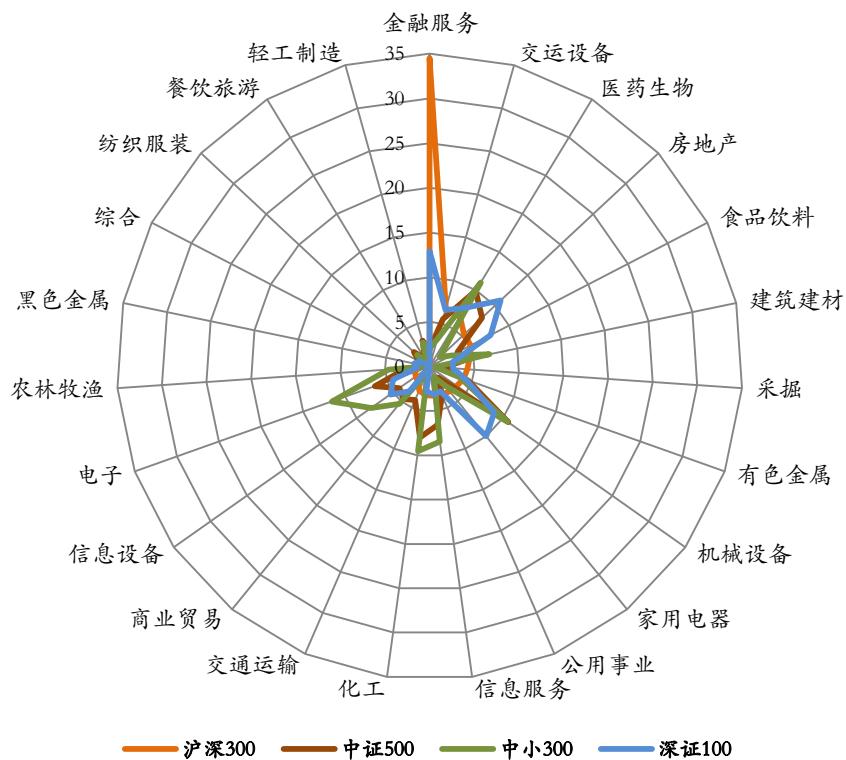
图1 成份行业贡献率与月度涨跌幅



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34.5%。机械设备、医药生物和房地产行业在中证500指数中权重居前，依次为10.8%、9.93%和8.04%。金融服务、房地产和家用电器行业在深证100指数中权重位列前三，依次为12.9%、10.9%和10.0%。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 11.6%、11.0% 和 10.7%。

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 0.33%，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% 以内，取得了良好的跟踪效果。

表 1 基金净值与跟踪误差

基金简称	2013 年 12 月		2013 年 11 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)		
广发沪深 300	1.04	1.33	1.084	1.374	0.7292	2008-12-30
广发中小板 300ETF	0.9527	0.8656	0.9802	0.8906	0.2850	2011-06-03
广发中小板 300 联接	0.8676	0.8676	0.8911	0.8911	0.3374	2011-06-09
广发深证 100 分级	0.8479	0.8708	0.8803	0.9032	0.8859	2012-05-07
广发中证 500ETF	1.0768	1.0768	1.1119	1.1119	0.3311	2013-04-11
广发中证 500 联接	0.8566	0.8566	0.8829	0.8829	0.3312	2009-11-26

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

12月沪深两市均下跌，覆盖两市的申万A指下跌3.88%。指数方面，本期核心市场指数中，中小板300跌幅最小，下跌2.65%，上证50表现最差，跌幅为5.21%。

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	1661.41	1662.39	1709.58	1522.59	1574.78	-5.21%	4355.31
上证180	5295.08	5272.78	5422.56	4890.61	5040.27	-4.81%	8729.50
深证成指	8542.61	8461.49	8648.01	7887.37	8121.79	-4.93%	2013.59
深证100P	2804.41	2774.81	2836.13	2614.18	2702.61	-3.63%	3673.43
中小板指	5121.59	5009.12	5080.31	4794.74	4979.86	-2.77%	2562.55
中小板300	980.80	957.57	971.30	914.36	954.80	-2.65%	5429.50
创业板指	1366.83	1296.70	1317.69	1194.75	1304.44	-4.56%	2603.35
沪深300	2438.94	2423.97	2486.64	2259.58	2330.03	-4.47%	12822.15
中证500	3946.38	3870.03	3965.16	3687.40	3829.10	-2.97%	8314.19
申万A指	2222.32	2186.18	2227.66	2059.86	2136.01	-3.88%	38902.09

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	2182.36	2150.21	2200.18	1948.54	1988.80	-8.87%	971.39
全指材料	2145.19	2108.41	2165.67	1990.92	2052.32	-4.33%	4216.34
全指工业	2543.69	2491.51	2548.62	2342.52	2433.93	-4.31%	7522.83
全指可选	3737.05	3653.14	3802.33	3495.00	3615.29	-3.26%	6205.33
全指消费	5801.75	5701.07	5841.15	5462.60	5684.35	-2.02%	2482.32
全指医药	6541.35	6419.52	6610.14	6248.24	6609.94	1.05%	2334.64
全指金融	3487.44	3503.50	3601.43	3227.78	3350.18	-3.94%	5126.23
全指信息	3584.29	3459.74	3500.21	3200.63	3408.49	-4.90%	4421.78
全指电信	3455.96	3335.94	3394.90	3025.13	3194.03	-7.58%	1040.54
全指公用	1714.07	1708.43	1769.32	1614.24	1652.26	-3.61%	857.14
中证全指	3008.75	2961.82	3020.09	2789.33	2893.21	-3.84%	38417.42

图 3 核心指数月度表现

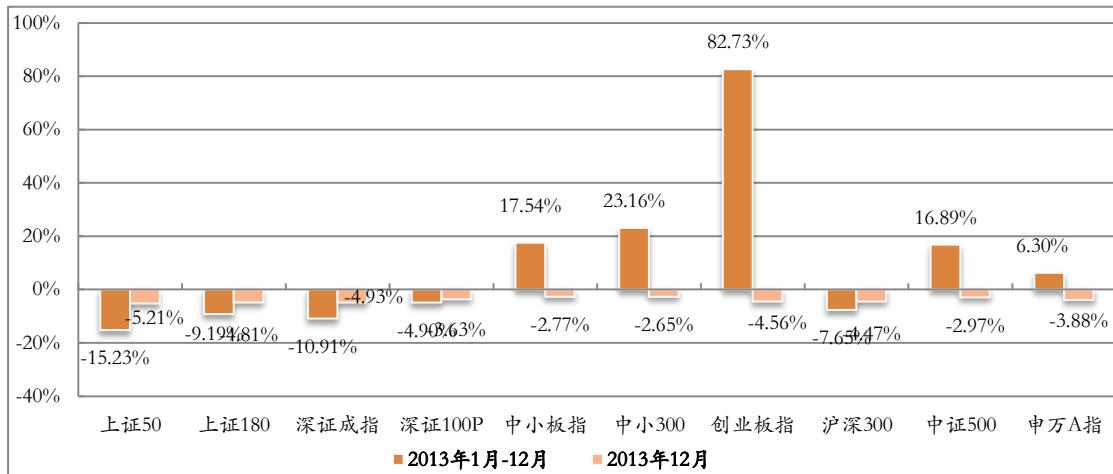


图 4 核心指数本月绝对收益

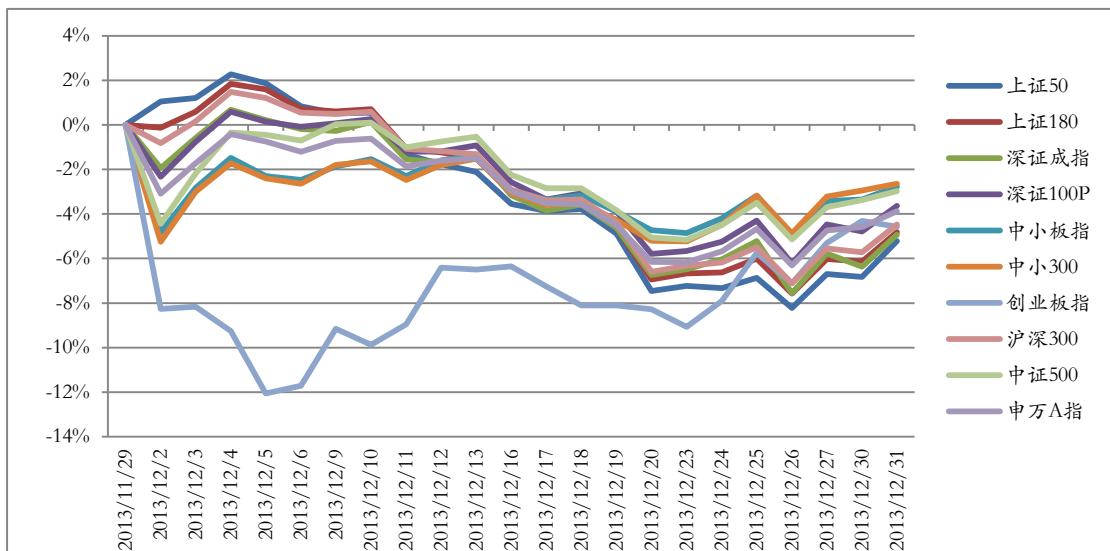
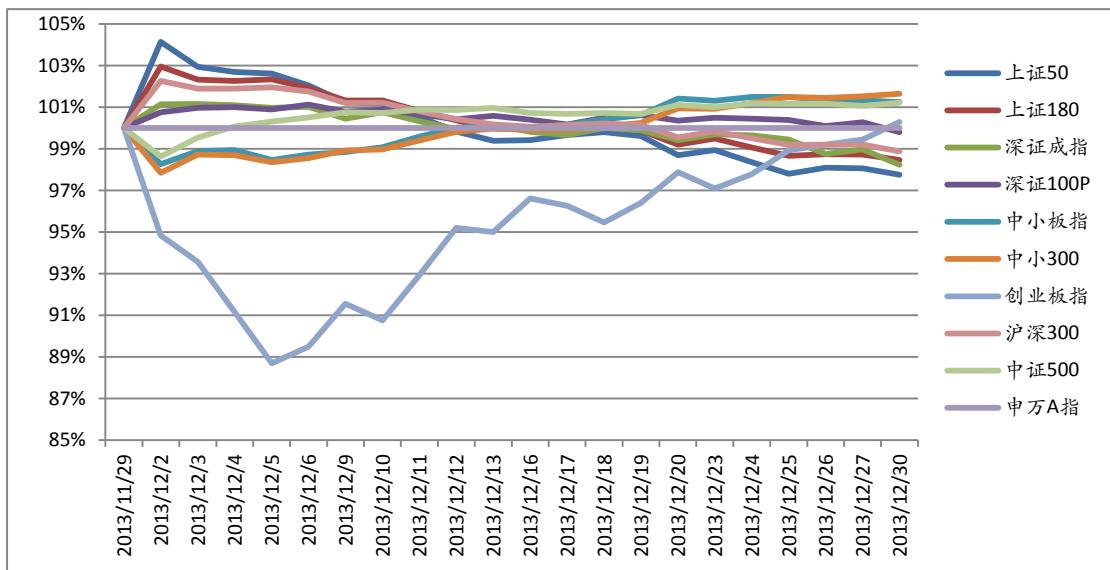


图 5 核心指数本月超额收益对比



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

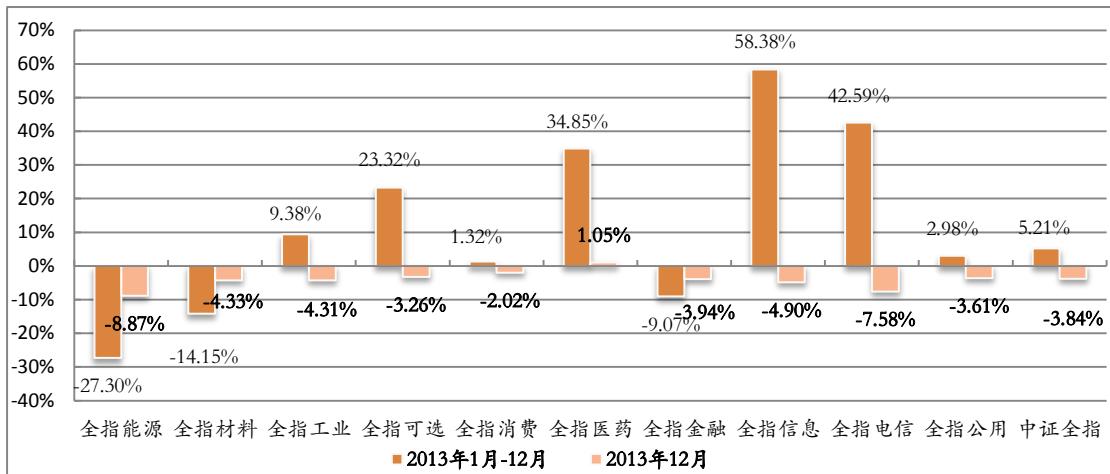


图 7 行业指数本月绝对收益

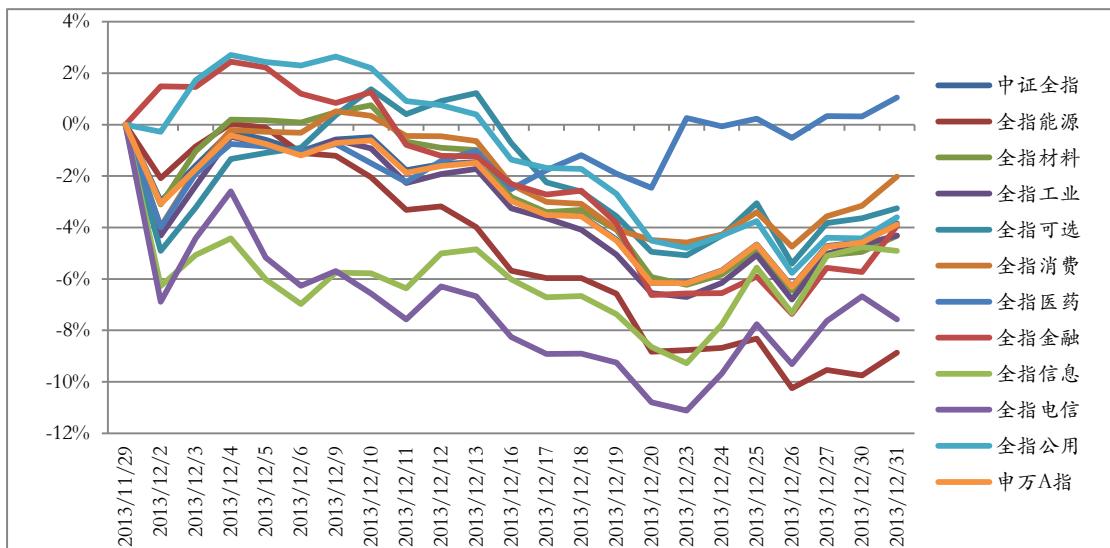
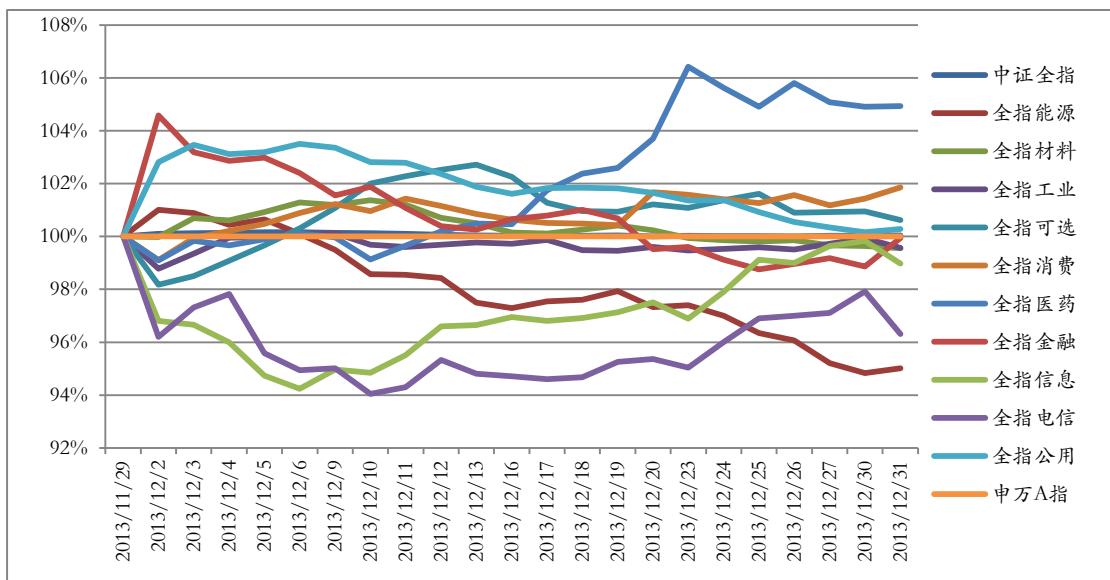


图 8 行业指数本月超额收益对比



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

12月份核心指数的估值水平较11月有所下降，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7.42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	8.41	7.55	7.42	1.21
上证180	8.58	7.74	7.57	1.23
深证成指	15.40	14.41	13.37	2.20
深证100P	18.86	17.07	15.82	2.27
中小板指数	30.07	28.09	26.25	3.77
中小板300	33.47	30.78	27.74	3.47
创业板指P	64.13	55.96	46.54	5.78
沪深300	9.57	8.65	8.46	1.34
中证500	27.95	24.70	21.90	2.33
申万A指	12.68	11.29	10.45	1.59

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	10.67	10.71	10.54	1.26
全指材料	24.64	24.70	22.34	1.72
全指工业	18.68	17.47	15.54	1.76
全指可选	22.28	19.22	16.49	2.42
全指消费	20.67	19.36	18.11	3.31
全指医药	40.81	35.84	32.72	4.42
全指金融	7.04	6.21	6.05	1.10
全指信息	53.38	44.63	38.15	4.20
全指电信	37.49	33.17	26.66	2.03
全指公用	15.70	10.20	10.06	1.46
中证全指	12.66	11.29	10.44	1.59

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%
601318	中国平安	41.73	0.41	20.22	8.74
600036	招商银行	10.89	-0.18	14.42	7.87
600016	民生银行	7.72	-10.13	12.05	7.63
601166	兴业银行	10.14	-5.23	16.89	5.07
600000	浦发银行	9.43	-5.61	26.04	4.62
贡献前 5 名样本股					
代码	简称	收盘	涨跌幅%	换手率%	贡献点数
600999	招商证券	12.68	15.90	109.54	2.62
600015	华夏银行	8.57	4.26	31.05	0.45
600383	金地集团	6.68	8.97	25.40	0.35
600010	包钢股份	4.31	9.95	0.00	0.00
601857	中国石油	7.71	-2.53	10.83	-0.50
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
600999	招商证券	12.68	15.90	109.54	2.62
600010	包钢股份	4.31	9.95	0.00	0.00
600383	金地集团	6.68	8.97	25.40	0.35
600015	华夏银行	8.57	4.26	31.05	0.45
601318	中国平安	41.73	0.41	20.22	-3.10
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
600256	广汇能源	8.74	-22.72	31.81	-5.65
600111	包钢稀土	22.27	-15.99	39.84	-4.86
601299	中国北车	4.92	-12.92	34.34	-2.26
600547	山东黄金	17.25	-12.61	21.34	-1.24
601699	潞安环能	10.67	-11.08	26.86	-1.17

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%
601318	中国平安	41.73	0.41	20.22	5.56
600036	招商银行	10.89	-0.18	14.42	5.00
600016	民生银行	7.72	-10.13	12.05	4.85
601166	兴业银行	10.14	-5.23	16.89	3.23
600000	浦发银行	9.43	-5.61	26.04	2.94
贡献前 5 名样本股					
代码	简称	收盘	涨跌幅%	换手率%	贡献点数
600999	招商证券	12.68	15.90	109.54	5.31
600690	青岛海尔	19.50	13.24	27.72	5.25
600276	恒瑞医药	37.98	12.10	25.34	4.25
600196	复星医药	19.59	12.65	60.52	3.45
600759	正和股份	7.97	72.89	227.94	3.24
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
600759	正和股份	7.97	72.89	227.94	3.24
600999	招商证券	12.68	15.90	109.54	5.31
600690	青岛海尔	19.50	13.24	27.72	5.25
600196	复星医药	19.59	12.65	60.52	3.45
600276	恒瑞医药	37.98	12.10	25.34	4.25
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
600316	洪都航空	17.38	-23.00	124.58	-3.10
600256	广汇能源	8.74	-22.72	31.81	-11.51
600546	山煤国际	4.95	-18.18	51.88	-1.69
600348	阳泉煤业	7.06	-17.62	24.03	-2.83
600598	北大荒	11.31	-17.20	108.26	-2.52

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%
000651	格力电器	32.66	4.68	14.92	9.22
000002	万科 A	8.03	-8.33	15.60	8.68
000001	平安银行	12.25	-9.93	28.13	6.43
002024	苏宁云商	9.03	-17.53	64.39	4.73
000776	广发证券	12.48	-1.27	30.43	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
000651	格力电器	32.66	4.68	14.92	27.73
000895	双汇发展	47.08	4.39	11.56	12.71
000333	美的集团	50.00	4.36	22.40	11.57
000783	长江证券	10.40	3.79	59.03	4.41
000725	京东方 A	2.15	0.00	34.25	-0.73
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
000651	格力电器	32.66	4.68	14.92	27.73
000895	双汇发展	47.08	4.39	11.56	12.71
000333	美的集团	50.00	4.36	22.40	11.57
000783	长江证券	10.40	3.79	59.03	4.41
002142	宁波银行	9.23	0.44	26.16	-1.16
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
000063	中兴通讯	13.07	-19.82	45.36	-58.33
002024	苏宁云商	9.03	-17.53	64.39	-78.25
000937	冀中能源	7.42	-14.12	26.03	-10.85
000768	中航飞机	9.54	-11.17	27.69	-14.86
000401	冀东水泥	8.48	-10.55	57.23	-5.23

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%
000651	格力电器	32.66	4.68	14.92	5.79
000002	万科 A	8.03	-8.33	15.60	5.45
000001	平安银行	12.25	-9.93	28.13	4.04
002024	苏宁云商	9.03	-17.53	64.39	2.97
000776	广发证券	12.48	-1.27	30.43	2.88
贡献前 5 名样本股					
代码	简称	收盘	涨跌幅%	换手率%	贡献点数
000651	格力电器	32.66	4.68	14.92	5.82
000581	威孚高科	30.80	11.59	41.56	4.10
000895	双汇发展	47.08	4.39	11.56	2.65
000333	美的集团	50.00	4.36	22.40	2.42
000729	燕京啤酒	8.10	10.05	22.87	1.88
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
000550	江铃汽车	25.41	15.55	56.89	0.82
000581	威孚高科	30.80	11.59	41.56	4.10
000876	新希望	14.33	10.57	57.07	1.58
000729	燕京啤酒	8.10	10.05	22.87	1.88
002007	华兰生物	28.70	8.22	62.34	1.46
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
000063	中兴通讯	13.07	-19.82	45.36	-12.20
002155	辰州矿业	7.89	-18.91	35.48	-2.65
002024	苏宁云商	9.03	-17.53	64.39	-16.37
000780	平庄能源	4.56	-14.29	30.11	-0.71
000937	冀中能源	7.42	-14.12	26.03	-2.27

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	9.03	-17.53	64.39	6.14
002241	歌尔声学	35.08	-9.17	19.09	3.98
002415	海康威视	22.98	-7.04	18.24	3.89
002236	大华股份	40.88	-2.55	18.27	3.25
002353	杰瑞股份	79.37	3.48	14.85	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
002252	上海莱士	47.50	50.08	94.50	15.36
002152	广电运通	19.19	11.89	55.00	8.10
002385	大北农	16.35	7.71	38.19	7.79
002219	恒康医疗	24.62	22.12	70.08	7.37
002038	双鹭药业	50.55	5.29	23.26	6.75
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
002252	上海莱士	47.50	50.08	94.50	15.36
002242	九阳股份	9.88	30.51	189.04	5.73
002219	恒康医疗	24.62	22.12	70.08	7.37
002262	恩华药业	28.17	12.73	20.39	2.44
002152	广电运通	19.19	11.89	55.00	8.10
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	7.89	-18.91	35.48	-10.08
002129	中环股份	18.58	-17.71	50.18	-11.62
002024	苏宁云商	9.03	-17.53	64.39	-62.28
002601	佰利联	17.43	-14.22	36.54	-2.16
002190	成飞集成	15.15	-14.07	43.69	-3.49

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	9.03	-17.53	64.39	3.55
002241	歌尔声学	35.08	-9.17	19.09	2.30
002415	海康威视	22.98	-7.04	18.24	2.25
002236	大华股份	40.88	-2.55	18.27	1.88
002353	杰瑞股份	79.37	3.48	14.85	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
002240	威华股份	14.35	86.36	31.82	1.73
002252	上海莱士	47.50	50.08	94.50	1.70
002152	广电运通	19.19	11.89	55.00	0.90
002385	大北农	16.35	7.71	38.19	0.86
002219	恒康医疗	24.62	22.12	70.08	0.82
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
002240	威华股份	14.35	86.36	31.82	1.73
002252	上海莱士	47.50	50.08	94.50	1.70
002242	九阳股份	9.88	30.51	189.04	0.64
002126	银轮股份	10.41	26.95	166.08	0.57
002424	贵州百灵	25.35	22.94	417.18	0.58
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
002046	轴研科技	7.88	-22.29	239.32	-0.34
002163	中航三鑫	3.76	-20.17	64.42	-0.35
002342	巨力索具	5.78	-19.16	41.02	-0.31
002155	辰州矿业	7.89	-18.91	35.48	-1.12
002080	中材科技	12.33	-18.56	43.94	-0.39

7、创业板指

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	27.82	-12.02	227.77	5.76
300070	碧水源	40.99	-8.91	22.15	4.81
300104	乐视网	40.80	-5.01	88.33	3.68
300058	蓝色光标	51.80	-4.25	21.49	3.51
300024	机器人	48.70	9.00	60.49	3.03
贡献前 5 名样本股					
代码	简称	收盘	涨跌幅%	换手率%	贡献点数
300024	机器人	48.70	9.00	60.49	3.93
300077	国民技术	24.90	14.85	116.66	2.12
300199	翰宇药业	21.20	14.84	29.58	1.68
300017	网宿科技	84.70	4.57	98.02	1.59
300181	佐力药业	27.00	23.91	114.28	1.59
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
300021	大禹节水	11.52	25.35	243.77	1.35
300181	佐力药业	27.00	23.91	114.28	1.59
300185	通裕重工	4.70	15.76	229.08	1.15
300006	莱美药业	28.98	15.46	39.56	1.09
300077	国民技术	24.90	14.85	116.66	2.12
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
300052	中青宝	24.77	-25.08	180.90	-3.90
300315	掌趣科技	28.68	-23.56	171.14	-8.00
300118	东方日升	6.38	-21.91	61.50	-1.88
300303	聚飞光电	20.01	-20.25	41.28	-1.95
300059	东方财富	15.18	-20.02	59.37	-5.53

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%
601318	中国平安	41.73	0.41	20.22	3.85
600036	招商银行	10.89	-0.18	14.42	3.46
600016	民生银行	7.72	-10.13	12.05	3.36
601166	兴业银行	10.14	-5.23	16.89	2.23
600000	浦发银行	9.43	-5.61	26.04	2.03
贡献前 5 名样本股					
代码	简称	收盘	涨跌幅%	换手率%	贡献点数
600999	招商证券	12.68	15.90	109.54	1.71
600690	青岛海尔	19.50	13.24	27.72	1.67
000651	格力电器	32.66	4.68	14.92	1.48
600276	恒瑞医药	37.98	12.10	25.34	1.36
600196	复星医药	19.59	12.65	60.52	1.09
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
600999	招商证券	12.68	15.90	109.54	1.71
000963	华东医药	46.00	13.92	18.46	0.55
600690	青岛海尔	19.50	13.24	27.72	1.67
600196	复星医药	19.59	12.65	60.52	1.09
600276	恒瑞医药	37.98	12.10	25.34	1.36
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
600316	洪都航空	17.38	-23.00	124.58	-1.00
600256	广汇能源	8.74	-22.72	31.81	-3.68
000063	中兴通讯	13.07	-19.82	45.36	-2.76
002155	辰州矿业	7.89	-18.91	35.48	-0.58
600546	山煤国际	4.95	-18.18	51.88	-0.54

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%
600388	龙净环保	33.52	-4.45	87.27	0.63
600499	科达机电	20.09	-1.47	26.19	0.59
600570	恒生电子	20.86	0.58	14.34	0.57
002008	大族激光	13.49	5.31	95.62	0.54
002465	海格通信	20.78	-4.77	83.05	0.53
贡献前 5 名样本股					
代码	简称	收盘	涨跌幅%	换手率%	贡献点数
600759	正和股份	7.97	72.89	227.94	4.74
002252	上海莱士	47.50	50.08	94.50	4.74
002219	恒康医疗	24.62	22.12	70.08	2.23
002152	广电运通	19.19	11.89	55.00	2.06
000028	国药一致	46.30	18.60	22.78	1.88
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
600759	正和股份	7.97	72.89	227.94	4.74
002252	上海莱士	47.50	50.08	94.50	4.74
002424	贵州百灵	25.35	22.94	417.18	1.53
002698	博实股份	29.55	22.82	55.44	1.32
002219	恒康医疗	24.62	22.12	70.08	2.23
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
600073	上海梅林	8.78	-21.40	82.67	-2.05
600088	中视传媒	15.52	-20.53	90.77	-1.35
002342	巨力索具	5.78	-19.16	41.02	-1.03
002075	沙钢股份	3.09	-19.11	18.11	-0.72
600880	博瑞传播	16.98	-17.37	86.46	-3.02

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%
601318	中国平安	41.73	0.41	20.22	1.99
600016	民生银行	7.72	-10.13	12.05	1.84
600036	招商银行	10.89	-0.18	14.42	1.42
601166	兴业银行	10.14	-5.23	16.89	1.13
600030	中信证券	12.75	-1.16	30.14	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
600690	青岛海尔	19.50	13.24	27.72	0.77
000651	格力电器	32.66	4.68	14.92	0.64
600276	恒瑞医药	37.98	12.10	25.34	0.62
600196	复星医药	19.59	12.65	60.52	0.51
600999	招商证券	12.68	15.90	109.54	0.51
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
002240	威华股份	14.35	86.36	31.82	0.45
600759	正和股份	7.97	72.89	227.94	0.47
300149	量子高科	17.30	70.95	318.70	0.11
600626	申达股份	8.95	59.54	234.10	0.31
002252	上海莱士	47.50	50.08	94.50	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
002640	百圆裤业	15.42	-41.08	267.40	-0.08
601268	*ST 二重	2.54	-38.35	49.87	-0.13
002517	泰亚股份	7.90	-35.93	210.23	-0.04
002681	奋达科技	48.93	-31.85	385.64	-0.21
600149	廊坊发展	5.61	-29.79	24.31	-0.19

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。