

广发基金指数月报

(2014年1月2日—2014年1月30日)

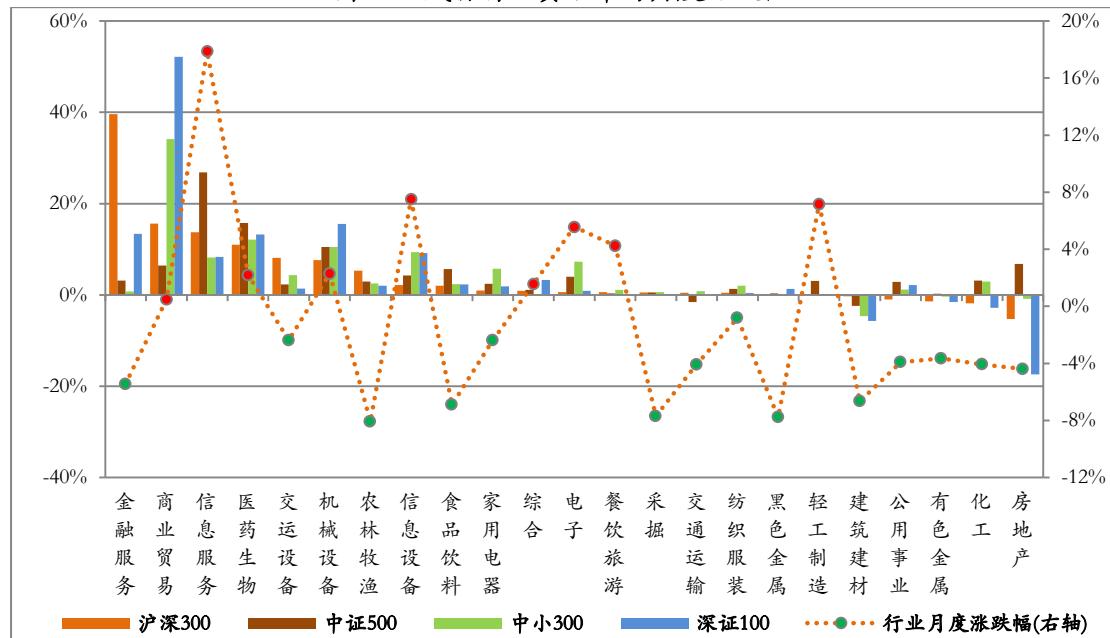
广发基金数量投资部

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

本月市场下跌，申万一级行业中信息服务、信息设备、轻工制造等9个行业上涨0.49%-17.9%，其余14个申万一级行业均下跌，其中农林牧渔行业表现最差，跌幅为8.08%。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%；商业贸易行业上涨对中小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%。

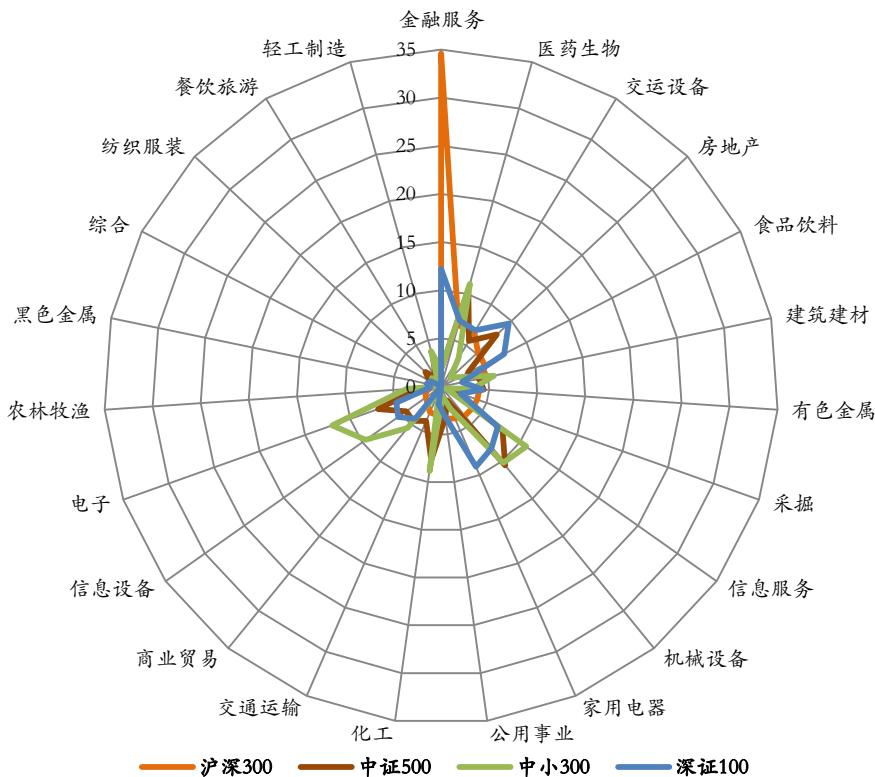
图1 成份行业贡献率与月度涨跌幅



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34.6%。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10.5%、10.4%和7.92%。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12.2%、9.6%和9.1%。电子、医药生

物和信息服务行业在中小 300 指数中权重居前，分别为 12.0%、11.1% 和 10.8%。

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 0.13%，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 1.1% 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	2014 年 1 月		2013 年 12 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	1.0916	1.0916	1.0768	1.0768	0.1322	2013-4-11
广发中证 500 联接	0.8649	0.8649	0.8566	0.8566	1.0819	2009-11-26
广发沪深 300	0.985	1.275	1.04	1.33	0.7311	2008-12-30
广发中小板 300ETF	0.9801	0.8905	0.9527	0.8656	0.2984	2011-6-3
广发中小板 300 联接	0.8916	0.8916	0.8676	0.8676	0.2648	2011-6-9
广发深证 100 分级	0.7762	0.8316	0.8479	0.8708	0.3519	2012-5-7

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

1月沪深两市下跌，覆盖两市的申万A指下跌1.15%。指数方面，本期核心市场指数中，创业板指大幅上涨14.68%，中小板300和中小板指均小幅上涨；而深成指表现最差，跌幅为6.76%。

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	1574.78	1570.05	1570.05	1459.45	1477.35	-6.19%	3146.72
上证180	5040.27	5026.10	5027.91	4677.17	4782.29	-5.12%	6868.92
深证成指	8121.79	8083.77	8124.56	7477.79	7572.63	-6.76%	1958.13
深证100P	2702.61	2694.00	2711.55	2509.69	2571.57	-4.85%	4155.31
中小板指	4979.86	4975.65	5133.83	4781.96	5030.20	1.01%	3172.74
中小板300	954.80	954.33	1000.00	920.25	983.22	2.98%	6293.65
创业板指	1304.44	1302.30	1507.87	1299.34	1495.98	14.68%	2946.87
沪深300	2330.03	2323.43	2325.99	2156.46	2202.45	-5.48%	10597.54
中证500	3829.10	3823.32	3916.67	3588.74	3885.42	1.47%	7038.81
申万A指	2136.01	2131.06	2142.05	2019.00	2111.47	-1.15%	35110.58

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	1988.80	1984.14	1984.14	1806.58	1819.67	-8.50%	774.93
全指材料	2052.32	2052.35	2060.28	1908.99	1973.61	-3.83%	3418.24
全指工业	2433.93	2429.59	2442.86	2271.18	2393.21	-1.67%	6134.52
全指可选	3615.29	3608.02	3726.84	3407.35	3688.83	2.03%	5616.13
全指消费	5684.35	5668.59	5668.59	5291.44	5306.07	-6.65%	2030.01
全指医药	6609.94	6610.24	6753.85	6394.90	6722.84	1.71%	2302.81
全指金融	3350.18	3336.09	3338.27	3103.97	3165.55	-5.51%	3423.43
全指信息	3408.49	3398.39	3808.36	3365.16	3772.84	10.69%	6299.39
全指电信	3194.03	3192.53	3478.07	3135.62	3440.93	7.73%	1120.09
全指公用	1652.26	1649.00	1651.97	1538.58	1601.99	-3.04%	577.47
中证全指	2893.21	2887.01	2900.91	2733.12	2856.84	-1.26%	34754.39

图 3 核心指数月度表现

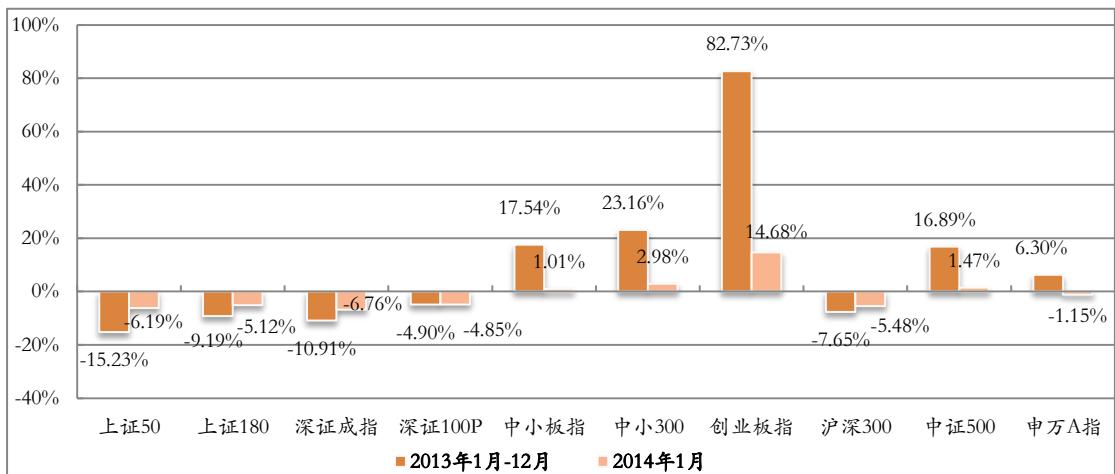


图 4 核心指数本月绝对收益

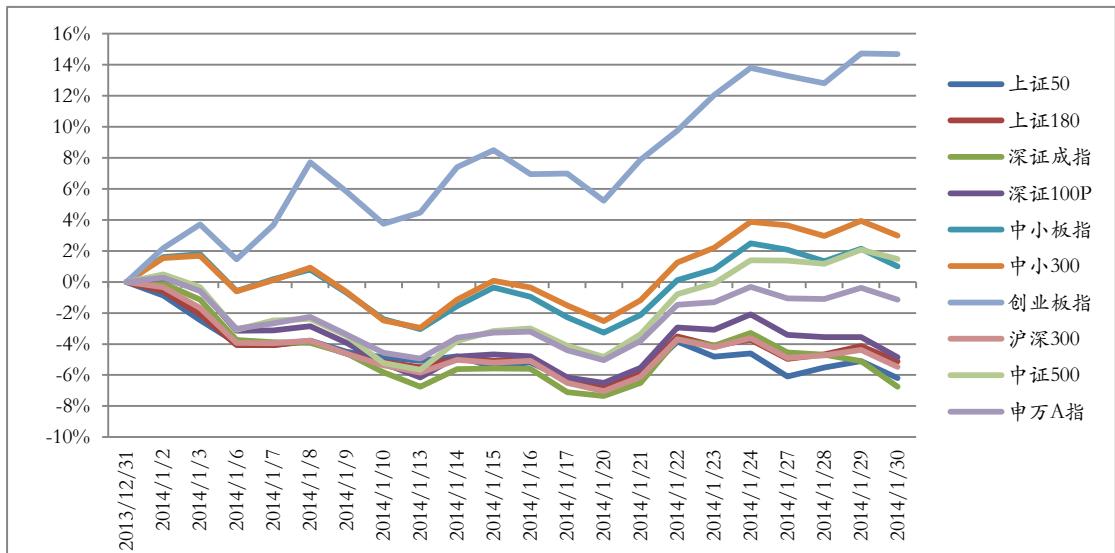
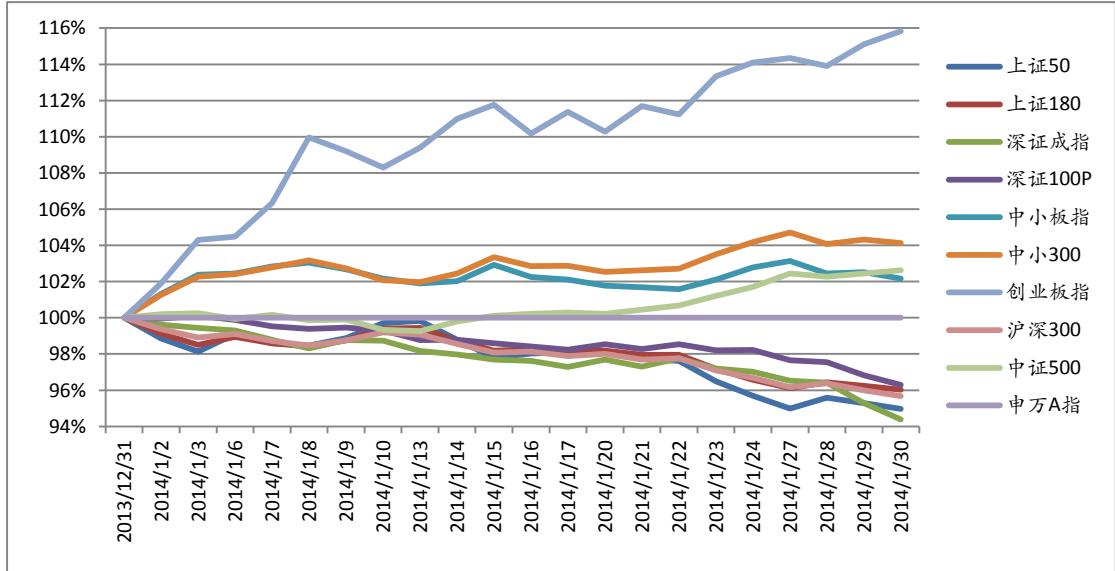


图 5 核心指数本月超额收益对比



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

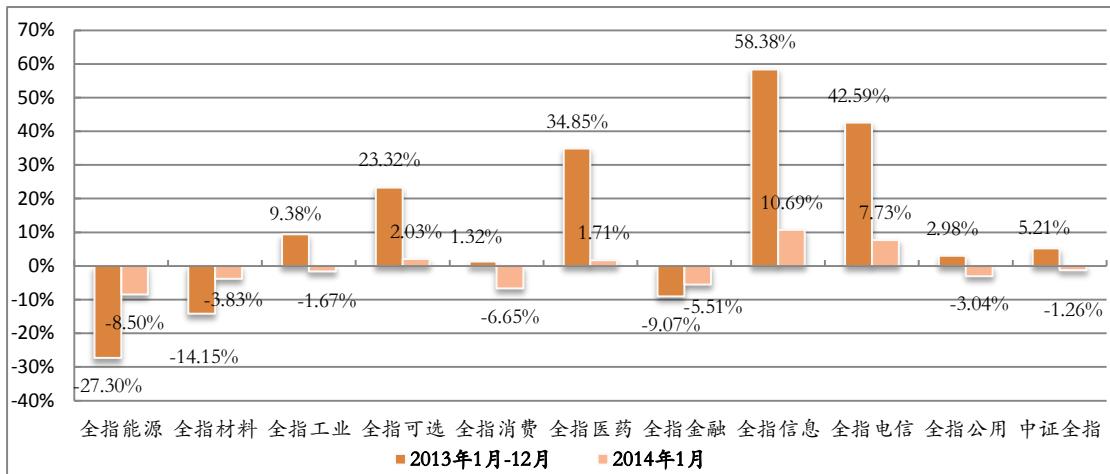


图 7 行业指数本月绝对收益

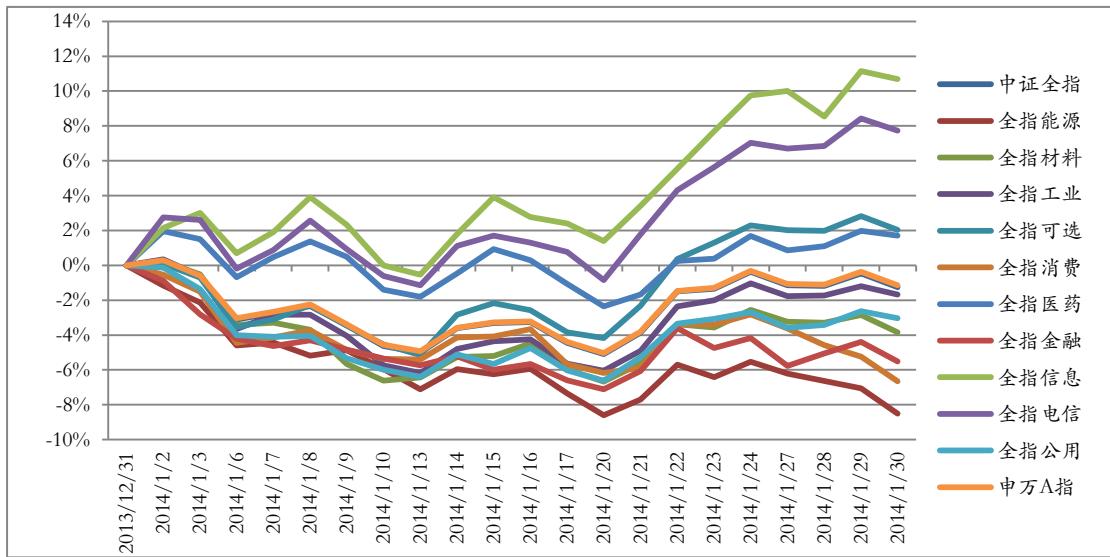
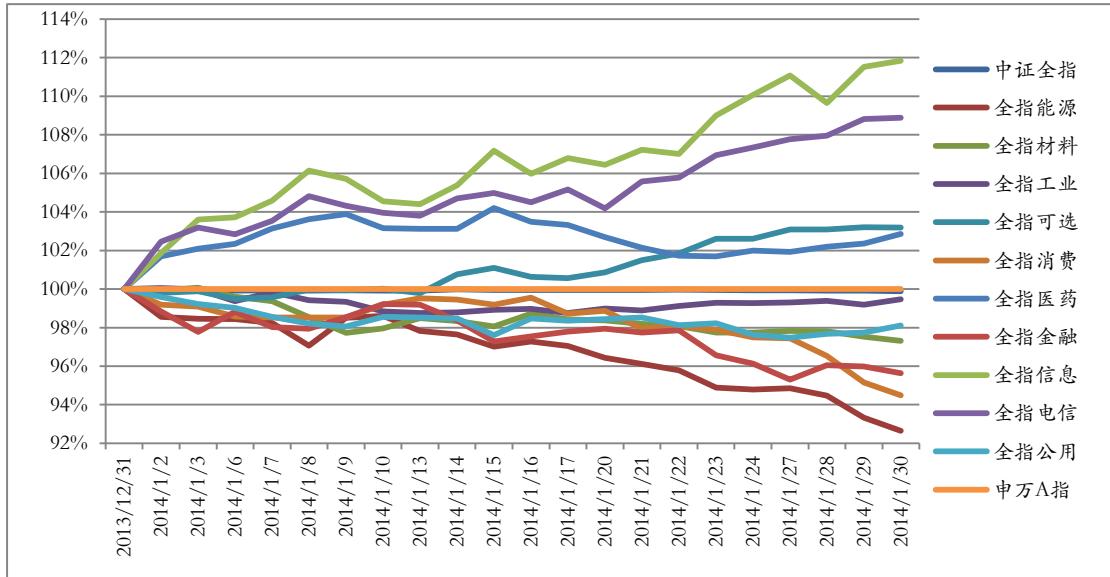


图 8 行业指数本月超额收益对比



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

2014 年 1 月份核心指数的估值水平较 2013 年 12 月小幅下降，市场平均动态（2013 年）市盈率为 10.3 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 7.03 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	7.98	7.16	7.03	1.15
上证 180	8.19	7.37	7.22	1.17
深证成指	14.51	13.52	12.65	2.02
深证 100P	18.01	16.25	15.16	2.13
中小板指数	29.97	27.72	25.90	3.73
中小板 300	34.16	31.28	28.16	3.52
创业板指 P	72.72	63.84	54.43	6.58
沪深 300	9.11	8.22	8.06	1.27
中证 500	28.17	25.27	22.74	2.36
申万 A 指	12.46	11.12	10.29	1.56

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	10.19	10.24	10.08	1.20
全指材料	23.49	23.80	21.39	1.65
全指工业	18.42	17.35	15.38	1.72
全指可选	22.72	19.53	16.90	2.44
全指消费	19.45	18.40	17.03	3.09
全指医药	41.39	36.45	34.00	4.48
全指金融	6.69	5.89	5.75	1.05
全指信息	59.35	48.72	43.32	4.57
全指电信	39.75	35.21	29.52	2.13
全指公用	14.80	9.99	9.63	1.39
中证全指	12.42	11.09	10.25	1.56

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	39.14	-6.21	14.78	8.76
600036	招商银行	10.36	-4.87	8.55	8.00
600016	民生银行	7.34	-4.92	7.88	7.76
601166	兴业银行	9.35	-7.79	13.03	5.00
600000	浦发银行	9.17	-2.76	15.60	4.80
贡献前 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	40.89	10.74	47.59	1.83
600519	贵州茅台	132.20	2.98	21.32	1.09
600028	中国石化	4.46	-0.45	13.96	-0.08
600332	白云山	27.11	-1.77	39.18	-0.17
600547	山东黄金	16.49	-4.41	31.74	-0.37
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	40.89	10.74	47.59	1.83
600519	贵州茅台	132.20	2.98	21.32	1.09
600028	中国石化	4.46	-0.45	13.96	-0.08
601328	交通银行	3.78	-1.56	6.10	-0.65
601006	大秦铁路	7.26	-1.76	9.33	-0.54
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
601117	中国化学	6.20	-22.50	43.98	-2.45
600256	广汇能源	6.88	-21.28	35.12	-4.02
601699	潞安环能	8.69	-18.56	30.00	-1.25
601766	中国南车	4.24	-15.37	26.72	-2.50
600549	厦门钨业	20.87	-13.19	36.08	-0.60

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	39.14	-6.21	14.78	5.50
600036	招商银行	10.36	-4.87	8.55	5.02
600016	民生银行	7.34	-4.92	7.88	4.86
601166	兴业银行	9.35	-7.79	13.03	3.14
600000	浦发银行	9.17	-2.76	15.60	3.01
贡献前 5 名样本股					
代码	简称	收盘	涨跌幅%	换手率%	贡献点数
600109	国金证券	22.84	34.59	115.34	4.28
600588	用友软件	19.71	42.41	71.81	3.91
600690	青岛海尔	21.18	8.62	19.05	3.84
600637	百视通	40.89	10.74	47.59	3.71
600893	航空动力	23.95	25.20	58.06	3.67
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
600588	用友软件	19.71	42.41	71.81	3.91
600880	博瑞传播	23.16	36.40	147.34	3.57
600633	浙报传媒	41.39	36.29	141.07	1.84
600109	国金证券	22.84	34.59	115.34	4.28
600759	正和股份	10.70	34.25	146.88	2.32
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
600702	沱牌舍得	10.85	-27.86	49.02	-1.60
600598	北大荒	8.20	-27.50	79.67	-3.06
601117	中国化学	6.20	-22.50	43.98	-5.02
600256	广汇能源	6.88	-21.28	35.12	-8.17
600597	光明乳业	17.74	-20.09	39.43	-3.88

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	28.36	-13.17	17.70	8.08
000002	万科 A	7.38	-8.09	18.02	7.88
000001	平安银行	11.40	-6.94	18.97	5.91
002024	苏宁云商	10.38	14.95	77.40	5.28
000333	美的集团	46.86	-6.28	12.77	4.26
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	10.38	14.95	77.40	52.01
000100	TCL 集团	2.50	7.30	65.07	12.20
002594	比亚迪	38.65	2.57	29.72	3.50
000063	中兴通讯	13.27	1.53	36.76	3.41
000725	京东方 A	2.13	-0.93	27.88	-1.48
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	10.38	14.95	77.40	52.01
000100	TCL 集团	2.50	7.30	65.07	12.20
002594	比亚迪	38.65	2.57	29.72	3.50
000063	中兴通讯	13.27	1.53	36.76	3.41
000725	京东方 A	2.13	-0.93	27.88	-1.48
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
000568	泸州老窖	16.37	-18.72	37.81	-24.69
002241	歌尔声学	28.88	-17.67	42.13	-41.89
000983	西山煤电	5.99	-15.63	14.49	-16.03
000651	格力电器	28.36	-13.17	17.70	-92.75
002081	金螳螂	19.10	-13.10	41.37	-15.36

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	28.36	-13.17	17.70	4.98
000002	万科 A	7.38	-8.09	18.02	4.85
000001	平安银行	11.40	-6.94	18.97	3.64
002024	苏宁云商	10.38	14.95	77.40	3.25
000333	美的集团	46.86	-6.28	12.77	2.63
贡献前 5 名样本股					
代码	简称	收盘	涨跌幅%	换手率%	贡献点数
002024	苏宁云商	10.38	14.95	77.40	10.88
300104	乐视网	51.40	25.98	133.87	6.50
000793	华闻传媒	13.95	17.42	37.34	4.74
300027	华谊兄弟	30.71	10.39	128.27	4.60
002230	科大讯飞	54.30	13.48	54.65	4.36
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
300104	乐视网	51.40	25.98	133.87	6.50
002405	四维图新	15.24	24.41	113.42	2.73
002106	莱宝高科	14.36	24.33	94.50	2.17
000559	万向钱潮	6.35	19.59	55.26	1.68
000793	华闻传媒	13.95	17.42	37.34	4.74
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
002344	海宁皮城	15.45	-25.65	42.59	-4.10
000568	泸州老窖	16.37	-18.72	37.81	-5.16
000876	新希望	11.75	-18.00	29.38	-3.06
002241	歌尔声学	28.88	-17.67	42.13	-8.78
000778	新兴铸管	5.25	-17.58	12.25	-3.12

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	10.38	14.95	77.40	6.41
002415	海康威视	21.21	-7.70	22.57	4.22
002241	歌尔声学	28.88	-17.67	42.13	3.13
002353	杰瑞股份	75.20	-5.25	19.18	2.83
002230	科大讯飞	54.30	13.48	54.65	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
002024	苏宁云商	10.38	14.95	77.40	41.94
002022	科华生物	22.85	35.85	23.71	18.56
002230	科大讯飞	54.30	13.48	54.65	16.86
002202	金风科技	9.76	15.78	44.37	15.61
002153	石基信息	64.00	34.79	31.35	13.53
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
002242	九阳股份	13.45	36.13	132.83	7.31
002022	科华生物	22.85	35.85	23.71	18.56
002396	星网锐捷	28.88	34.83	199.19	8.85
002153	石基信息	64.00	34.79	31.35	13.53
002048	宁波华翔	10.85	28.55	87.35	7.29
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
002344	海宁皮城	15.45	-25.65	42.59	-15.81
002241	歌尔声学	28.88	-17.67	42.13	-33.76
002269	美邦服饰	10.33	-16.22	47.84	-2.43
002310	东方园林	27.41	-15.69	46.90	-8.35
002299	圣农发展	8.13	-15.58	21.24	-4.70

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	10.38	14.95	77.40	3.63
002415	海康威视	21.21	-7.70	22.57	2.39
002241	歌尔声学	28.88	-17.67	42.13	1.77
002230	科大讯飞	54.30	13.48	54.65	1.60
002353	杰瑞股份	75.20	-5.25	19.18	1.60
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	10.38	14.95	77.40	4.65
002410	广联达	46.70	48.25	32.33	2.66
002022	科华生物	22.85	35.85	23.71	2.06
002400	省广股份	44.81	23.61	37.19	1.92
002230	科大讯飞	54.30	13.48	54.65	1.86
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
002181	粤传媒	19.16	80.93	208.21	1.66
002117	东港股份	23.43	58.20	136.88	0.89
002410	广联达	46.70	48.25	32.33	2.66
002261	拓维信息	28.98	46.81	288.31	1.19
002240	威华股份	20.27	41.25	241.29	1.33
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
002344	海宁皮城	15.45	-25.65	42.59	-1.75
002490	山东墨龙	8.60	-18.56	82.09	-0.30
002241	歌尔声学	28.88	-17.67	42.13	-3.74
002313	日海通讯	13.27	-17.22	90.57	-0.59
002663	普邦园林	14.18	-16.39	67.25	-0.56

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	30.71	10.39	128.27	5.44
300070	碧水源	37.10	-9.49	29.28	3.65
300058	蓝色光标	64.80	25.10	23.19	3.52
300104	乐视网	51.40	25.98	133.87	3.48
300124	汇川技术	69.01	17.99	19.21	2.76
贡献前 5 名样本股					
代码	简称	收盘	涨跌幅%	换手率%	贡献点数
300315	掌趣科技	41.44	44.49	187.77	10.93
300017	网宿科技	120.28	42.01	71.57	10.92
300104	乐视网	51.40	25.98	133.87	10.74
300058	蓝色光标	64.80	25.10	23.19	10.58
300027	华谊兄弟	30.71	10.39	128.27	7.67
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
300183	东软载波	47.80	55.75	169.72	3.28
300012	华测检测	24.20	49.85	34.46	4.02
300147	香雪制药	27.80	49.46	43.65	6.95
300315	掌趣科技	41.44	44.49	187.77	10.93
300017	网宿科技	120.28	42.01	71.57	10.92
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
300156	天立环保	9.45	-20.66	105.27	-1.29
300054	鼎龙股份	17.04	-13.50	47.20	-1.47
300070	碧水源	37.10	-9.49	29.28	-5.72
300298	三诺生物	63.76	-7.41	46.67	-0.58
300055	万邦达	36.39	-6.93	30.82	-0.94

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	39.14	-6.21	14.78	3.81
600036	招商银行	10.36	-4.87	8.55	3.48
600016	民生银行	7.34	-4.92	7.88	3.37
601166	兴业银行	9.35	-7.79	13.03	2.17
600000	浦发银行	9.17	-2.76	15.60	2.09
贡献前 5 名样本股					
代码	简称	收盘	涨跌幅%	换手率%	贡献点数
002024	苏宁云商	10.38	14.95	77.40	2.68
600718	东软集团	16.11	31.30	68.96	1.47
600109	国金证券	22.84	34.59	115.34	1.39
600588	用友软件	19.71	42.41	71.81	1.26
600690	青岛海尔	21.18	8.62	19.05	1.22
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
600588	用友软件	19.71	42.41	71.81	1.26
600109	国金证券	22.84	34.59	115.34	1.39
600718	东软集团	16.11	31.30	68.96	1.47
601099	太平洋	7.71	29.58	86.87	0.90
600893	航空动力	23.95	25.20	58.06	1.19
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
600598	北大荒	8.20	-27.50	79.67	-0.99
002344	海宁皮城	15.45	-25.65	42.59	-1.08
601117	中国化学	6.20	-22.50	43.98	-1.61
600783	鲁信创投	16.06	-21.70	60.45	-0.44
600256	广汇能源	6.88	-21.28	35.12	-2.61

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%
002400	省广股份	44.81	23.61	37.19	0.66
600499	科达机电	22.89	13.94	42.28	0.66
600587	新华医疗	83.67	19.68	23.34	0.62
002008	大族激光	15.40	14.16	109.21	0.61
002465	海格通信	23.61	13.62	81.91	0.60
贡献前 5 名样本股					
代码	简称	收盘	涨跌幅%	换手率%	贡献点数
002410	广联达	46.70	48.25	32.33	6.87
600880	博瑞传播	23.16	36.40	147.34	5.32
002022	科华生物	22.85	35.85	23.71	5.05
002181	粤传媒	19.16	80.93	208.21	5.00
002400	省广股份	44.81	23.61	37.19	4.86
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
002181	粤传媒	19.16	80.93	208.21	5.00
002410	广联达	46.70	48.25	32.33	6.87
600699	均胜电子	22.43	45.56	143.06	2.85
000620	新华联	7.90	43.64	344.14	1.62
600551	时代出版	23.11	41.69	254.36	2.88
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
600702	沱牌舍得	10.85	-27.86	49.02	-2.41
000799	酒鬼酒	11.30	-19.97	57.81	-1.35
600199	金种子酒	8.20	-19.13	43.44	-1.59
002490	山东墨龙	8.60	-18.56	82.09	-0.68
600292	中电远达	21.19	-18.15	70.12	-2.06

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	7.34	-4.92	7.88	1.91
601318	中国平安	39.14	-6.21	14.78	1.87
600036	招商银行	10.36	-4.87	8.55	1.35
600000	浦发银行	9.17	-2.76	15.60	1.05
601166	兴业银行	9.35	-7.79	13.03	1.05
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	10.38	14.95	77.40	1.29
600109	国金证券	22.84	34.59	115.34	0.98
002410	广联达	46.70	48.25	32.33	0.83
300315	掌趣科技	41.44	44.49	187.77	0.81
300017	网宿科技	120.28	42.01	71.57	0.77
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
002354	科冕木业	40.93	159.54	12.33	0.20
002195	海隆软件	33.86	114.30	55.35	0.25
002602	世纪华通	14.22	94.79	6.01	0.11
300129	泰胜风能	13.71	94.19	233.50	0.26
300226	上海钢联	70.10	89.46	203.07	0.35
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
000509	*ST 华塑	3.16	-77.45	62.52	-0.09
600702	沱牌舍得	10.85	-27.86	49.02	-0.24
600598	北大荒	8.20	-27.50	79.67	-0.48
600338	西藏珠峰	7.07	-26.81	109.86	-0.07
600072	中船股份	9.07	-25.84	51.87	-0.22

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。