

广发基金指数月报

(2014年2月7日-2014年2月28日)

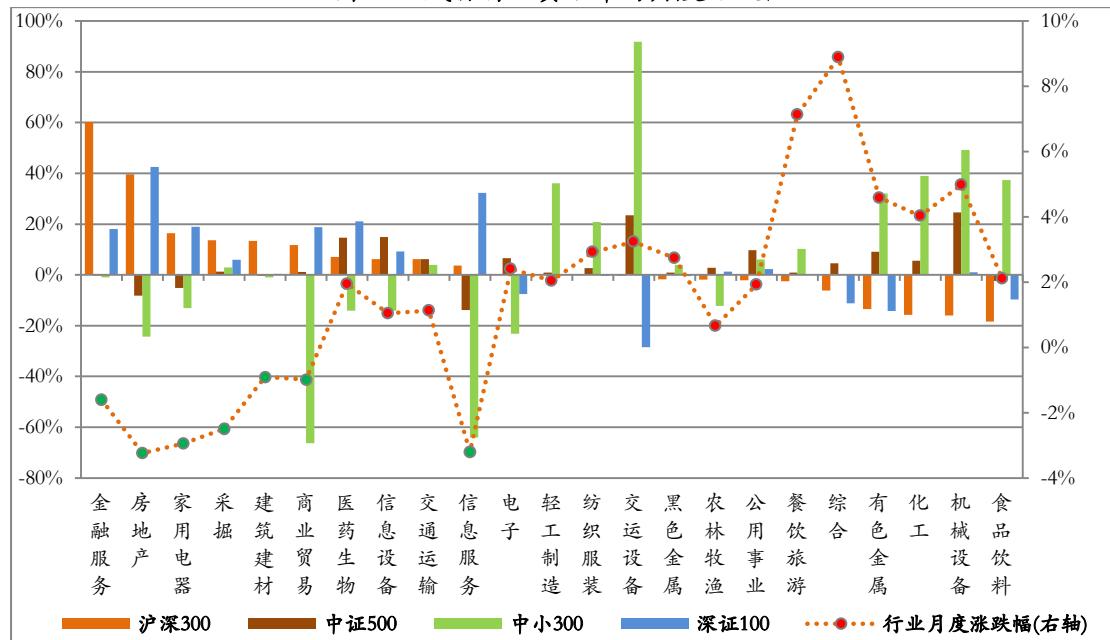
广发基金数量投资部

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

本月市场小幅上涨，申万一级行业中房地产、信息服务、家用电器等7个行业下跌0.91%-3.23%，其余16个申万一级行业均上涨，其中综合和餐饮旅游行业表现抢眼，涨幅均在7%以上。从各指数成份股的行业贡献率来看，金融服务业的下跌对沪深300指数影响最大，贡献率为60.2%；机械设备行业上涨对中证500指数贡献最大，贡献率为24.6%；交运设备行业上涨对中小300指数贡献居首，贡献率高达91.8%；房地产行业对深证100指数贡献最大，贡献率为42.5%。

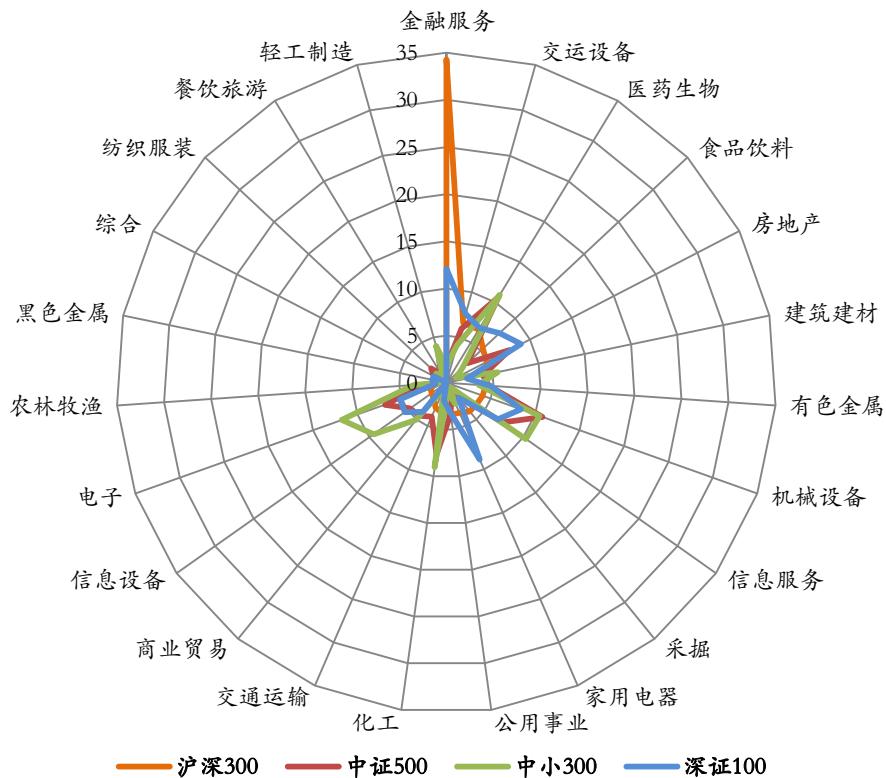
图1 成份行业贡献率与月度涨跌幅



以巨潮数据库提供的权重数据计算，本月末金融服务业在沪深300指数中所占权重居首，为34.3%。机械设备、医药生物和化工行业在中证500指数中权重居前，依次为10.8%、10.6%和7.65%。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12.1%、8.92%和8.85%。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%、10.9% 和 10.5%。

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 0.12%，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 0.7% 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	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 500 联接	0.8831	0.8831	0.8649	0.8649	0.1420	2009-11-26
广发沪深 300	0.973	1.263	0.985	1.275	0.6234	2008-12-30
广发中小板 300ETF	0.9855	0.8954	0.9801	0.8905	0.2065	2011-6-3
广发中小板 300 联接	0.8958	0.8958	0.8916	0.8916	0.2697	2011-6-9
广发深证 100 分级	0.7596	0.815	0.7762	0.8316	0.3120	2012-5-7
广发中证 500ETF	1.116	1.116	1.0916	1.0916	0.1176	2013-4-11

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

2月沪深两市小幅上涨，覆盖两市的申万A指上涨0.89%。指数方面，本期核心市场指数中，中证500上涨2.33%，中小板300小幅上涨0.65%；而创业板指表现最差，跌幅为4.08%。

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	1477.35	1467.36	1556.42	1429.61	1464.32	-0.88%	3599.56
上证180	4782.29	4751.04	5057.49	4635.15	4732.96	-1.03%	8120.09
深证成指	7572.63	7515.09	7997.02	7174.33	7365.93	-2.73%	2360.06
深证100P	2571.57	2552.32	2720.04	2456.96	2519.04	-2.04%	4699.54
中小板指	5030.20	4995.43	5426.09	4902.59	5029.20	-0.02%	3470.61
中小板300	983.22	976.55	1061.13	965.23	989.66	0.65%	7120.25
创业板指	1495.98	1489.05	1571.40	1393.00	1434.89	-4.08%	2598.44
沪深300	2202.45	2187.34	2331.70	2133.55	2178.97	-1.07%	12621.94
中证500	3885.42	3864.89	4232.88	3854.98	3975.93	2.33%	9246.71
申万A指	2111.47	2098.30	2262.94	2081.72	2130.18	0.89%	43474.30

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	1819.67	1815.59	2002.85	1803.99	1838.69	1.05%	1012.11
全指材料	1973.61	1963.74	2125.67	1958.76	2013.90	2.04%	4372.41
全指工业	2393.21	2379.47	2596.70	2370.71	2432.89	1.66%	7888.65
全指可选	3688.83	3661.52	3989.40	3571.83	3678.60	-0.28%	6967.82
全指消费	5306.07	5284.56	5728.78	5267.56	5389.75	1.58%	2183.62
全指医药	6722.84	6684.54	7278.64	6662.15	6833.40	1.64%	2779.63
全指金融	3165.55	3141.94	3318.93	3011.78	3086.58	-2.49%	3985.36
全指信息	3772.84	3746.73	4073.81	3706.94	3829.14	1.49%	6748.86
全指电信	3440.93	3412.11	3751.67	3393.75	3489.64	1.42%	1250.36
全指公用	1601.99	1595.04	1686.15	1582.50	1636.39	2.15%	693.97
中证全指	2856.84	2839.61	3057.48	2811.49	2877.26	0.71%	41574.67

图 3 核心指数月度表现

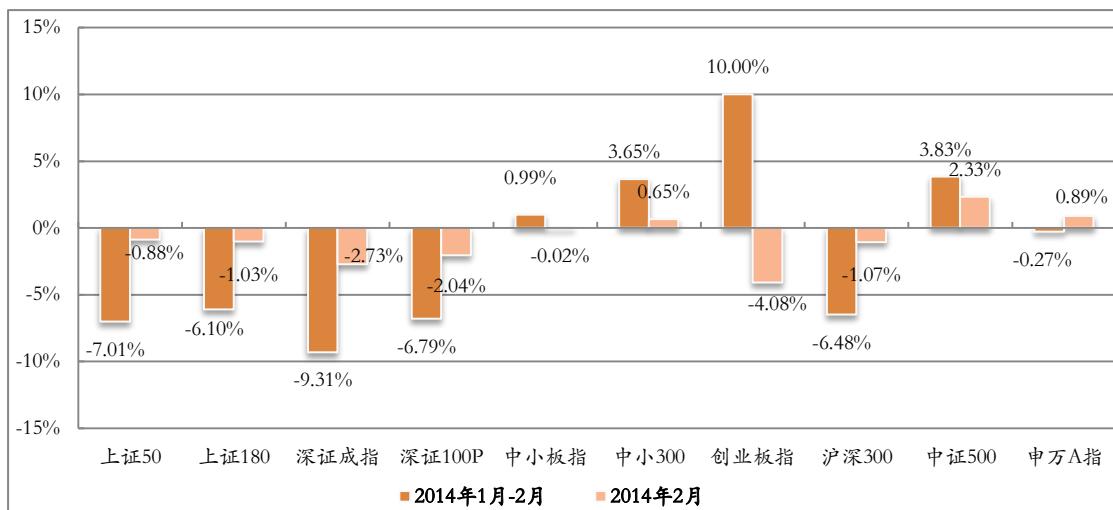


图 4 核心指数本月绝对收益

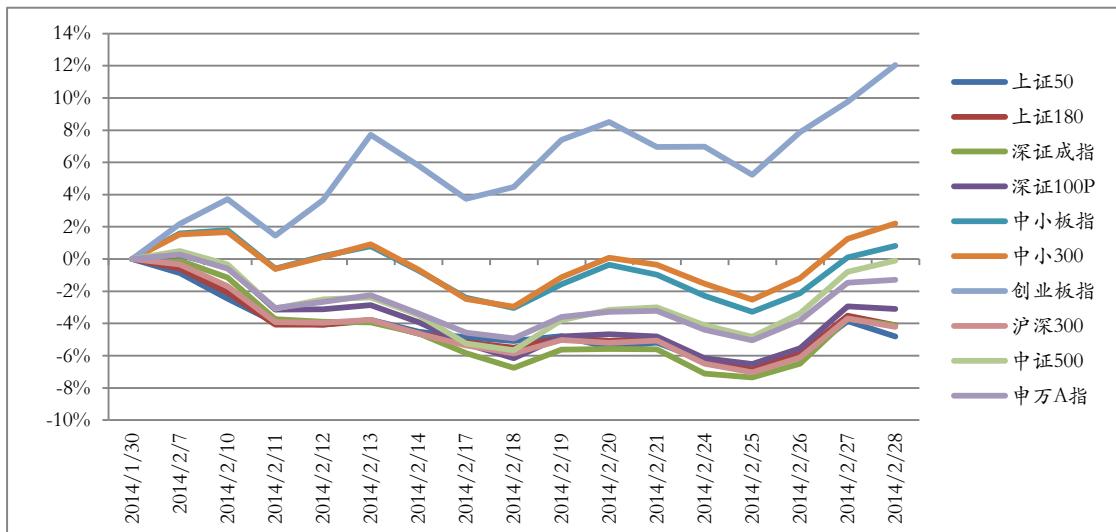
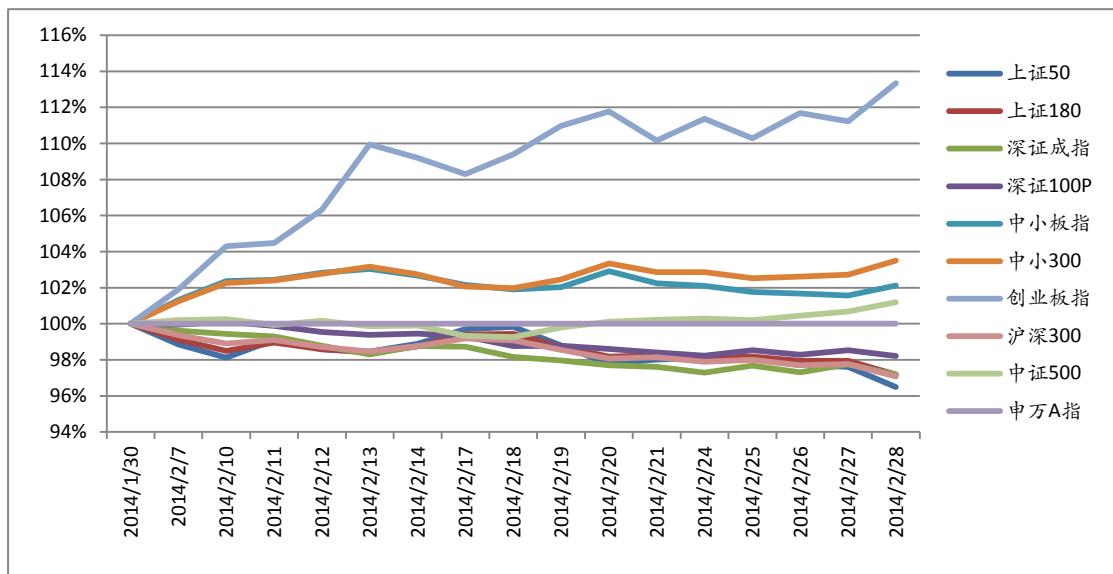


图 5 核心指数本月超额收益对比



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

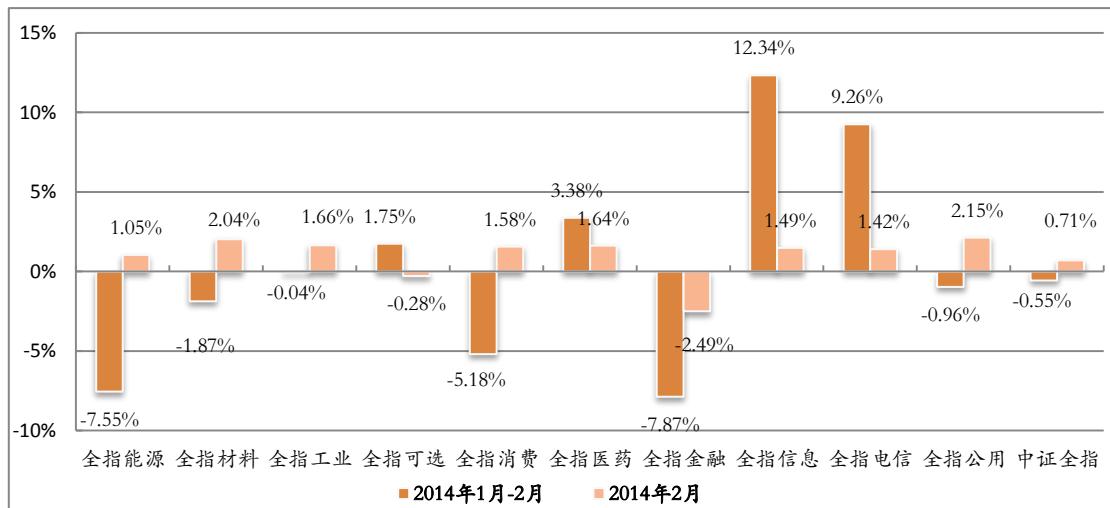


图 7 行业指数本月绝对收益

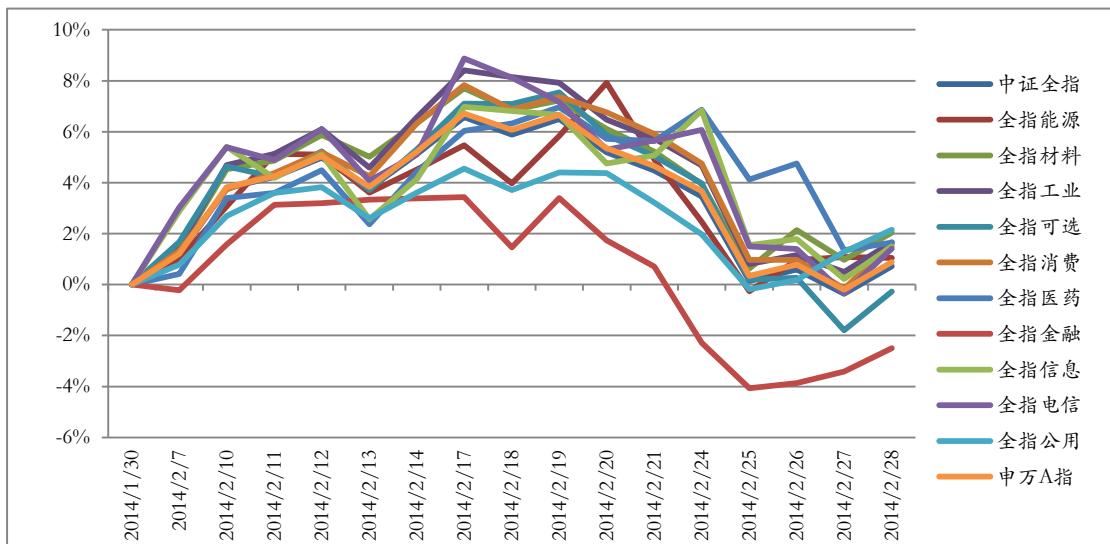
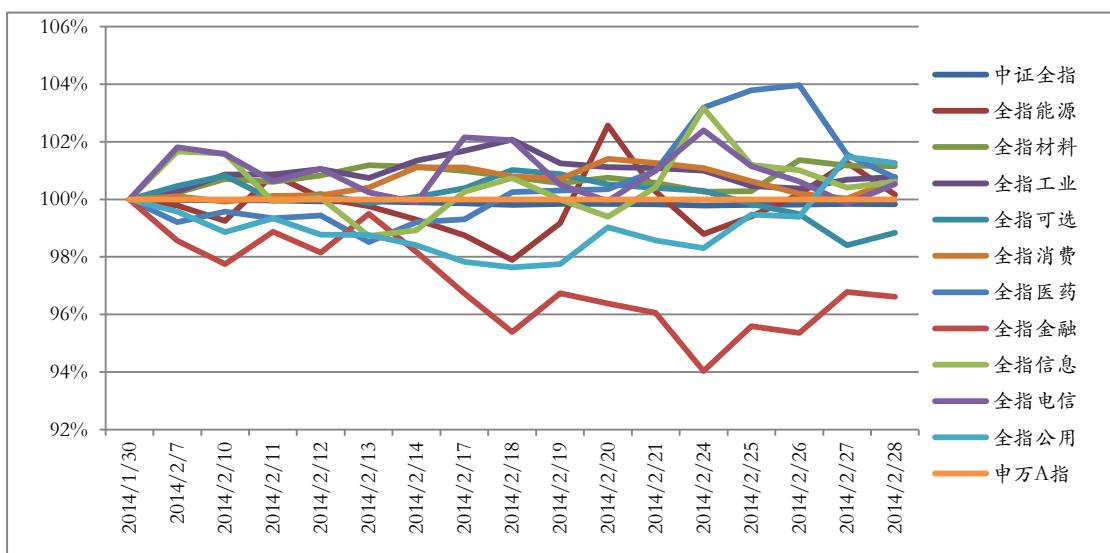


图 8 行业指数本月超额收益对比



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2月份核心指数的估值水平较1月微升，市场平均动态（2013年）市盈率为10.36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7.06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	8.03	7.20	7.06	1.15
上证180	8.20	7.37	7.18	1.17
深证成指	14.15	13.44	12.70	1.99
深证100P	17.66	16.13	15.19	2.09
中小板指数	31.28	29.16	27.50	3.69
中小板300	34.99	32.26	29.49	3.49
创业板指P	68.00	57.98	53.09	6.12
沪深300	9.10	8.22	8.02	1.27
中证500	28.52	25.76	23.59	2.39
申万A指	12.60	11.30	10.36	1.58

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	10.65	10.69	10.76	1.25
全指材料	23.69	23.97	21.73	1.67
全指工业	18.62	17.60	15.55	1.73
全指可选	22.23	19.41	16.88	2.43
全指消费	19.39	19.20	17.66	3.12
全指医药	41.86	36.94	35.01	4.50
全指金融	6.63	5.80	5.60	1.03
全指信息	59.77	48.03	43.78	4.51
全指电信	35.19	35.70	31.21	2.16
全指公用	15.16	10.29	9.81	1.42
中证全指	12.51	11.21	10.25	1.57

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	38.50	-1.64	13.05	8.70
600016	民生银行	7.53	2.59	10.28	8.03
600036	招商银行	9.93	-4.15	9.66	7.74
601166	兴业银行	9.12	-2.46	16.87	4.92
600000	浦发银行	8.91	-2.84	18.86	4.71
贡献前 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	150.02	13.48	16.64	5.11
600406	国电南瑞	18.74	32.91	54.77	4.68
600028	中国石化	5.37	20.40	33.67	3.48
600016	民生银行	7.53	2.59	10.28	2.97
600256	广汇能源	7.79	13.23	42.49	1.98
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
600406	国电南瑞	18.74	32.91	54.77	4.68
600028	中国石化	5.37	20.40	33.67	3.48
600547	山东黄金	18.85	14.31	47.37	1.16
600519	贵州茅台	150.02	13.48	16.64	5.11
600256	广汇能源	7.79	13.23	42.49	1.98
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
600637	百视通	35.39	-13.45	52.93	-2.53
600048	保利地产	6.75	-13.13	27.35	-3.03
601699	潞安环能	7.79	-10.36	39.58	-0.57
600999	招商证券	10.78	-8.49	59.10	-1.61
601117	中国化学	5.75	-7.26	47.04	-0.61

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	38.50	-1.64	13.05	5.46
600016	民生银行	7.53	2.59	10.28	5.04
600036	招商银行	9.93	-4.15	9.66	4.86
601166	兴业银行	9.12	-2.46	16.87	3.09
600000	浦发银行	8.91	-2.84	18.86	2.96
贡献前 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	150.02	13.48	16.64	10.39
600406	国电南瑞	18.74	32.91	54.77	9.44
600028	中国石化	5.37	20.40	33.67	7.05
601998	中信银行	5.27	45.98	94.50	6.90
600196	复星医药	21.75	21.17	61.60	6.11
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
601998	中信银行	5.27	45.98	94.50	6.90
600406	国电南瑞	18.74	32.91	54.77	9.44
600366	宁波韵升	16.28	23.80	97.43	1.53
600196	复星医药	21.75	21.17	61.60	6.11
600028	中国石化	5.37	20.40	33.67	7.05
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
603000	人民网	75.52	-18.59	80.84	-2.01
601216	内蒙君正	12.37	-18.46	134.24	-1.52
600633	浙报传媒	34.90	-15.68	90.81	-1.05
601633	长城汽车	30.89	-15.49	31.81	-3.18
601992	金隅股份	5.11	-13.98	38.76	-1.45

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	27.75	-2.15	27.08	8.13
000002	万科 A	6.72	-8.94	19.13	7.38
000001	平安银行	11.13	-2.37	22.94	5.93
002024	苏宁云商	9.35	-9.92	67.29	4.89
000776	广发证券	10.75	-6.44	19.08	4.01
贡献前 5 名样本股					
代码	简称	收盘	涨跌幅%	换手率%	贡献点数
002594	比亚迪	56.91	47.24	65.52	65.81
002304	洋河股份	50.97	28.00	57.94	25.71
000725	京东方 A	2.41	13.15	61.75	20.91
000100	TCL 集团	2.78	11.20	79.62	20.08
000858	五粮液	15.27	4.30	25.20	10.54
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
002594	比亚迪	56.91	47.24	65.52	65.81
002304	洋河股份	50.97	28.00	57.94	25.71
000725	京东方 A	2.41	13.15	61.75	20.91
000100	TCL 集团	2.78	11.20	79.62	20.08
000869	张裕 A	26.76	10.67	42.51	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
002236	大华股份	30.20	-17.62	43.45	-30.91
000333	美的集团	38.94	-16.90	18.94	-54.56
000024	招商地产	15.84	-14.38	38.39	-18.27
000625	长安汽车	9.70	-10.27	42.42	-17.04
002024	苏宁云商	9.35	-9.92	67.29	-39.68

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	27.75	-2.15	27.08	4.97
000002	万科 A	6.72	-8.94	19.13	4.51
000001	平安银行	11.13	-2.37	22.94	3.63
002024	苏宁云商	9.35	-9.92	67.29	2.99
000776	广发证券	10.75	-6.44	19.08	2.45
贡献前 5 名样本股					
代码	简称	收盘	涨跌幅%	换手率%	贡献点数
002594	比亚迪	56.91	47.24	65.52	13.76
000559	万向钱潮	11.97	88.50	173.97	9.08
002304	洋河股份	50.97	28.00	57.94	5.38
000400	许继电气	39.20	16.67	28.02	4.66
000725	京东方 A	2.41	13.15	61.75	4.37
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
000559	万向钱潮	11.97	88.50	173.97	9.08
002594	比亚迪	56.91	47.24	65.52	13.76
002304	洋河股份	50.97	28.00	57.94	5.38
000960	锡业股份	12.20	20.43	40.47	1.95
000009	中国宝安	11.18	19.32	67.41	3.83
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
002038	双鹭药业	41.31	-21.27	27.27	-5.92
300027	华谊兄弟	24.35	-20.71	96.04	-10.15
002236	大华股份	30.20	-17.62	43.45	-6.46
000333	美的集团	38.94	-16.90	18.94	-11.41
000961	中南建设	6.74	-16.48	99.33	-0.88

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	9.35	-9.92	67.29	3.25
002415	海康威视	21.99	3.68	31.06	2.46
002594	比亚迪	56.91	47.24	65.52	1.85
002241	歌尔声学	27.51	-4.74	39.19	1.68
002353	杰瑞股份	70.68	-6.01	23.67	1.50
贡献前 5 名样本股					
代码	简称	收盘	涨跌幅%	换手率%	贡献点数
002594	比亚迪	56.91	47.24	65.52	5.88
002304	洋河股份	50.97	28.00	57.94	2.30
002065	东华软件	45.70	16.61	32.45	1.73
002432	九安医疗	22.03	55.58	256.84	1.16
002312	三泰电子	30.47	28.24	59.43	1.11
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
002432	九安医疗	22.03	55.58	256.84	1.16
002594	比亚迪	56.91	47.24	65.52	5.88
002466	天齐锂业	46.97	40.88	191.98	0.47
002249	大洋电机	14.27	40.31	114.47	0.86
002070	众和股份	7.90	35.74	121.06	0.68
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
002416	爱施德	16.90	-26.78	90.90	-0.79
002285	世联行	15.61	-22.34	64.68	-0.63
002038	双鹭药业	41.31	-21.27	27.27	-2.53
002429	兆驰股份	12.48	-20.86	33.65	-1.09
002400	省广股份	36.50	-18.54	18.93	-1.86

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	24.35	-20.71	96.04	4.50
300070	碧水源	35.71	-3.75	34.87	3.66
300104	乐视网	49.40	-3.89	68.39	3.49
300124	汇川技术	73.02	5.81	21.33	3.04
300058	蓝色光标	52.69	-18.69	21.77	2.99
贡献前 5 名样本股					
代码	简称	收盘	涨跌幅%	换手率%	贡献点数
300253	卫宁软件	113.20	22.30	33.55	4.04
300088	长信科技	20.50	27.33	172.61	4.00
300005	探路者	23.70	21.17	71.23	3.49
300015	爱尔眼科	40.26	23.12	31.81	3.23
300168	万达信息	43.15	15.68	39.44	3.04
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
300044	赛为智能	13.35	46.22	2.39	1.81
300037	新宙邦	32.45	29.85	154.85	1.65
300088	长信科技	20.50	27.33	172.61	4.00
300015	爱尔眼科	40.26	23.12	31.81	3.23
300253	卫宁软件	113.20	22.30	33.55	4.04
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
300096	易联众	23.70	-24.45	45.27	-3.08
300205	天喻信息	25.24	-23.05	116.03	-2.26
300045	华力创通	18.70	-22.60	60.74	-2.01
300315	掌趣科技	32.65	-21.21	86.76	-7.53
300027	华谊兄弟	24.35	-20.71	96.04	-16.85

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	38.50	-1.64	13.05	3.79
600016	民生银行	7.53	2.59	10.28	3.50
600036	招商银行	9.93	-4.15	9.66	3.37
601166	兴业银行	9.12	-2.46	16.87	2.14
600000	浦发银行	8.91	-2.84	18.86	2.05
贡献前 5 名样本股					
代码	简称	收盘	涨跌幅%	换手率%	贡献点数
002594	比亚迪	56.91	47.24	65.52	3.83
600519	贵州茅台	150.02	13.48	16.64	3.32
600406	国电南瑞	18.74	32.91	54.77	3.03
600028	中国石化	5.37	20.40	33.67	2.24
601998	中信银行	5.27	45.98	94.50	2.21
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
002594	比亚迪	56.91	47.24	65.52	3.83
601998	中信银行	5.27	45.98	94.50	2.21
600406	国电南瑞	18.74	32.91	54.77	3.03
002304	洋河股份	50.97	28.00	57.94	1.61
600688	上海石化	3.74	27.64	114.32	0.81
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
002038	双鹭药业	41.31	-21.27	27.27	-1.35
603000	人民网	75.52	-18.59	80.84	-0.64
000596	古井贡酒	19.24	-18.58	94.29	-0.23
002236	大华股份	30.20	-17.62	43.45	-1.66
000333	美的集团	38.94	-16.90	18.94	-2.39

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%
600587	新华医疗	93.19	11.38	8.39	0.68
600499	科达机电	21.37	-6.64	32.49	0.60
002008	大族激光	15.20	-1.30	59.31	0.59
600594	益佰制药	40.10	2.32	16.47	0.59
600388	龙净环保	31.28	4.62	74.73	0.57
贡献前 5 名样本股					
代码	简称	收盘	涨跌幅%	换手率%	贡献点数
000559	万向钱潮	11.97	88.50	173.97	9.40
000897	津滨发展	6.19	37.55	145.16	4.57
000997	新大陆	24.07	32.47	134.35	4.42
600422	昆明制药	28.90	32.14	53.39	4.02
600654	飞乐股份	9.13	35.26	45.61	3.80
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
000559	万向钱潮	11.97	88.50	173.97	9.40
002249	大洋电机	14.27	40.31	114.47	2.45
600884	杉杉股份	18.01	37.90	111.90	2.97
000897	津滨发展	6.19	37.55	145.16	4.57
600654	飞乐股份	9.13	35.26	45.61	3.80
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
002416	爱施德	16.90	-26.78	90.90	-2.60
600551	时代出版	17.74	-23.24	179.35	-2.26
002285	世联行	15.61	-22.34	64.68	-1.61
002429	兆驰股份	12.48	-20.86	33.65	-2.97
000671	阳光城	7.30	-19.25	48.02	-2.26

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	7.53	2.59	10.28	1.93
601318	中国平安	38.50	-1.64	13.05	1.81
600036	招商银行	9.93	-4.15	9.66	1.27
600000	浦发银行	8.91	-2.84	18.86	1.01
601166	兴业银行	9.12	-2.46	16.87	1.00
贡献前 5 名样本股					
代码	简称	收盘	涨跌幅%	换手率%	贡献点数
002594	比亚迪	56.91	47.24	65.52	1.59
600519	贵州茅台	150.02	13.48	16.64	1.58
600406	国电南瑞	18.74	32.91	54.77	1.50
600028	中国石化	5.37	20.40	33.67	1.18
601998	中信银行	5.27	45.98	94.50	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
300108	双龙股份	15.74	120.45	219.89	0.17
000559	万向钱潮	11.97	88.50	173.97	0.98
002602	世纪华通	26.65	87.41	216.02	0.20
000554	泰山石油	8.88	83.47	226.26	0.35
300130	新国都	27.14	77.15	2.40	0.14
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
002416	爱施德	16.90	-26.78	90.90	-0.21
300096	易联众	23.70	-24.45	45.27	-0.21
600551	时代出版	17.74	-23.24	179.35	-0.20
300205	天喻信息	25.24	-23.05	116.03	-0.16
300045	华力创通	18.70	-22.60	60.74	-0.14

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。