

广发基金指数月报

(2014年3月3日—2014年3月31日)

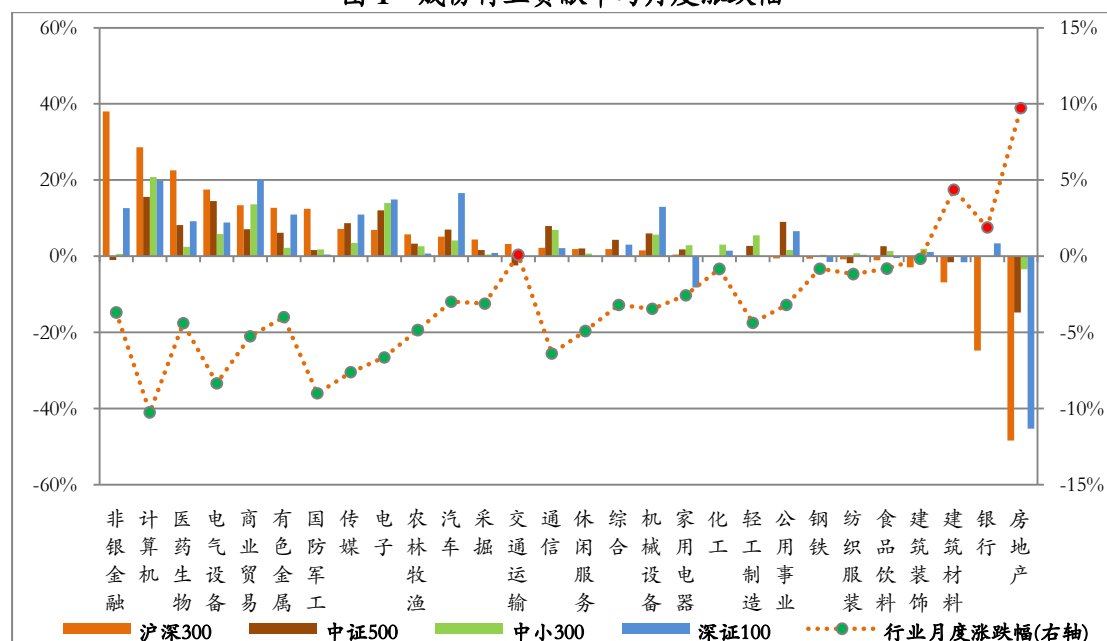
广发基金数量投资部

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

本月市场普跌，申万 28 个一级行业中仅房地产、建筑材料、银行和交通运输上涨，其中房地产行业涨幅高达 9.72%，其余 24 个行业跌幅 0.17%-10.25%。从各指数成份股的行业贡献率来看，非银金融行业的下跌对沪深 300 指数影响最大，贡献率为 38.0%；计算机行业下跌对中证 500 指数贡献最大，贡献率为 15.6%；计算机行业下跌对中小 300 指数贡献居首，贡献率为 20.8%；商业贸易行业对深证 100 指数贡献最大，贡献率为 20.1%。

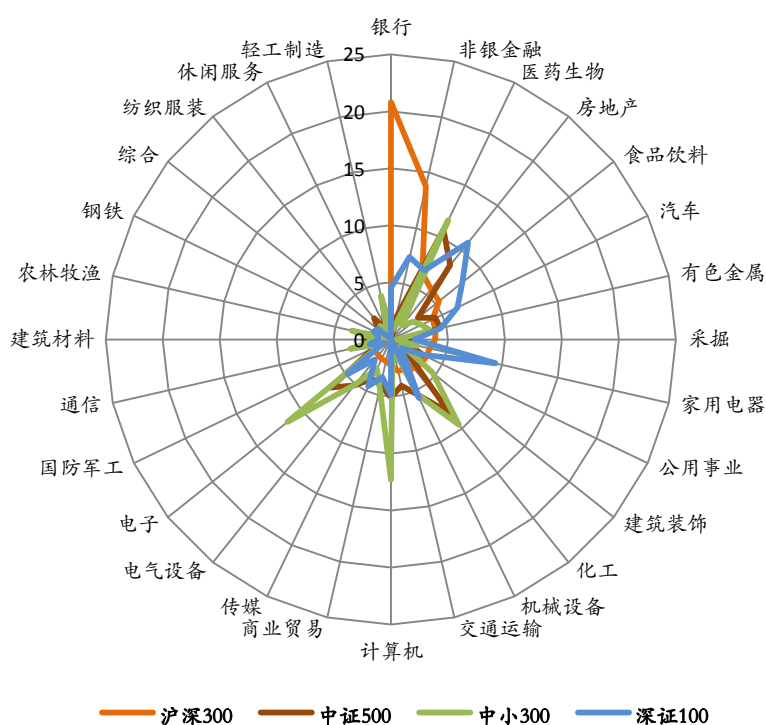
图 1 成份行业贡献率与月度涨跌幅



以巨潮数据库提供的权重数据计算，本月末银行行业在沪深 300 指数中所占权重居首，为 20.8%。医药生物、房地产和化工行业在中证 500 指数中权重居前，依次为 10.7%、8.36% 和 8.24%。房地产、家用电器和食品饮料行业在深证 100 指数中权重位列前三，依次为 10.9%、9.43% 和 8.02%。计算机、医药生物和电

子行业在中小 300 指数中权重居前，分别为 12.3%、11.6%和 11.6%。

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 0.20%，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 2.1% 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	2014 年 3 月		2014 年 2 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	0.8493	0.8493	0.8831	0.8831	2.0008	2009-11-26
广发沪深 300	0.958	1.248	0.973	1.263	0.7569	2008-12-30
广发中小板 300ETF	0.91	0.8268	0.9855	0.8954	0.2145	2011-6-3
广发中小板 300 联接	0.8305	0.8305	0.8958	0.8958	0.2366	2011-6-9
广发深证 100 分级	0.734	0.7894	0.7596	0.815	0.6879	2012-5-7
广发中证 500ETF	1.0771	1.0771	1.116	1.116	0.2015	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

3月沪深两市下跌，覆盖两市的申万A指下跌2.76%。指数方面，本期核心市场指数中，仅上证50上涨0.10%；而中小板指表现最差，跌幅为8.63%。

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	1464.32	1459.86	1486.85	1402.18	1465.78	0.10%	3997.01
上证180	4732.96	4721.75	4786.00	4526.83	4694.38	-0.82%	8432.93
深证成指	7365.93	7349.95	7410.66	6959.25	7189.58	-2.39%	2347.66
深证100P	2519.04	2515.35	2539.38	2376.34	2431.65	-3.47%	4484.12
中小板指	5029.20	5041.11	5098.20	4572.17	4595.02	-8.63%	2886.01
中小板300	989.66	991.25	1007.73	909.32	914.52	-7.59%	5932.66
创业板指	1434.89	1433.90	1493.39	1315.49	1327.80	-7.46%	2167.41
沪深300	2178.97	2173.91	2194.22	2077.76	2146.31	-1.50%	12640.32
中证500	3975.93	3975.54	4075.75	3803.73	3840.54	-3.41%	9010.91
申万A指	2130.18	2127.73	2162.84	2045.99	2071.41	-2.76%	41955.44

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	1838.69	1830.25	1864.16	1726.99	1752.16	-4.71%	982.90
全指材料	2013.90	2014.40	2052.19	1949.44	1991.47	-1.11%	4540.43
全指工业	2432.89	2435.88	2489.40	2311.32	2335.06	-4.02%	7476.87
全指可选	3678.60	3668.87	3748.55	3491.99	3532.66	-3.97%	5956.69
全指消费	5389.75	5380.71	5656.16	5277.74	5304.27	-1.59%	2301.19
全指医药	6833.40	6824.92	6976.05	6500.06	6541.41	-4.27%	2466.55
全指金融	3086.58	3071.28	3209.92	2960.82	3150.28	2.06%	5054.58
全指信息	3829.14	3842.46	3912.54	3460.31	3488.95	-8.88%	5475.44
全指电信	3489.64	3495.37	3629.32	3203.21	3224.31	-7.60%	1060.70
全指公用	1636.39	1634.22	1673.83	1554.41	1608.76	-1.69%	804.31
中证全指	2877.26	2873.64	2919.91	2761.23	2801.24	-2.64%	39918.32

图3 核心指数月度表现

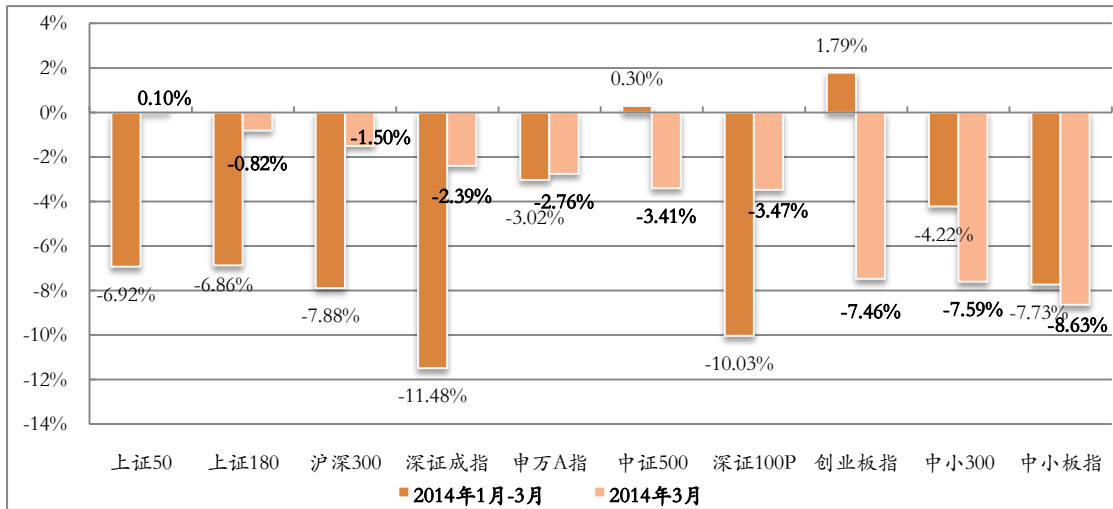


图4 核心指数本月绝对收益

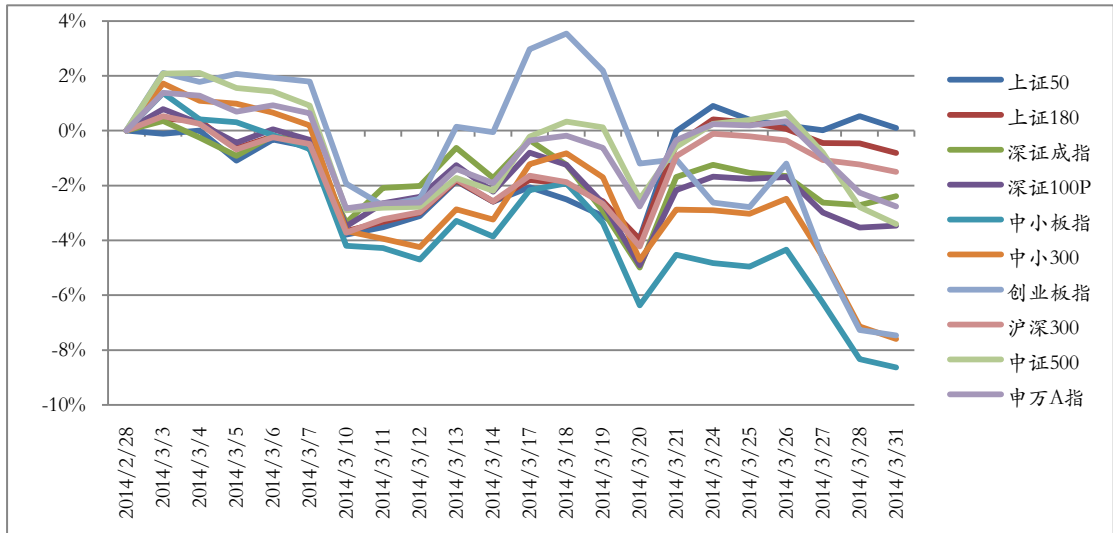
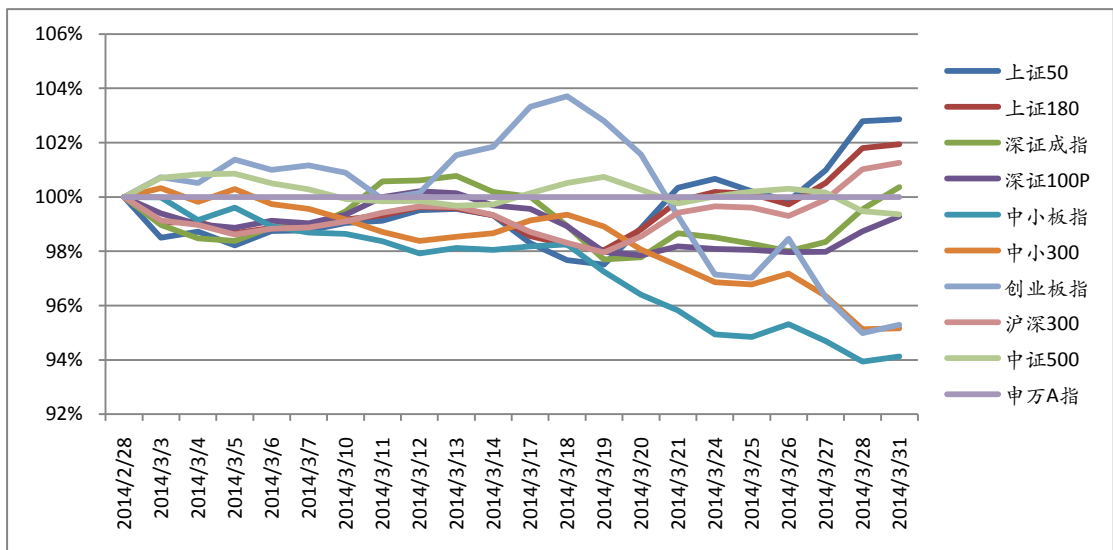


图5 核心指数本月超额收益对比



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

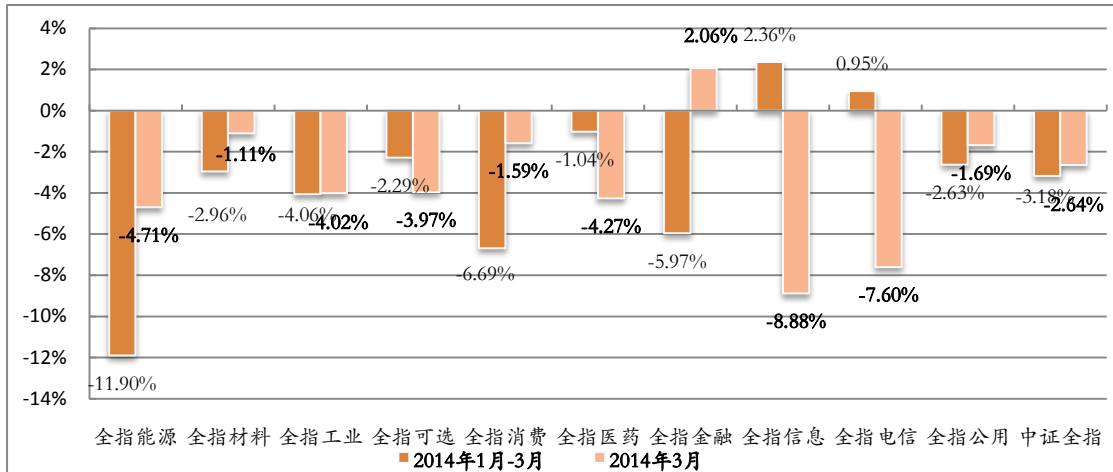


图 7 行业指数本月绝对收益

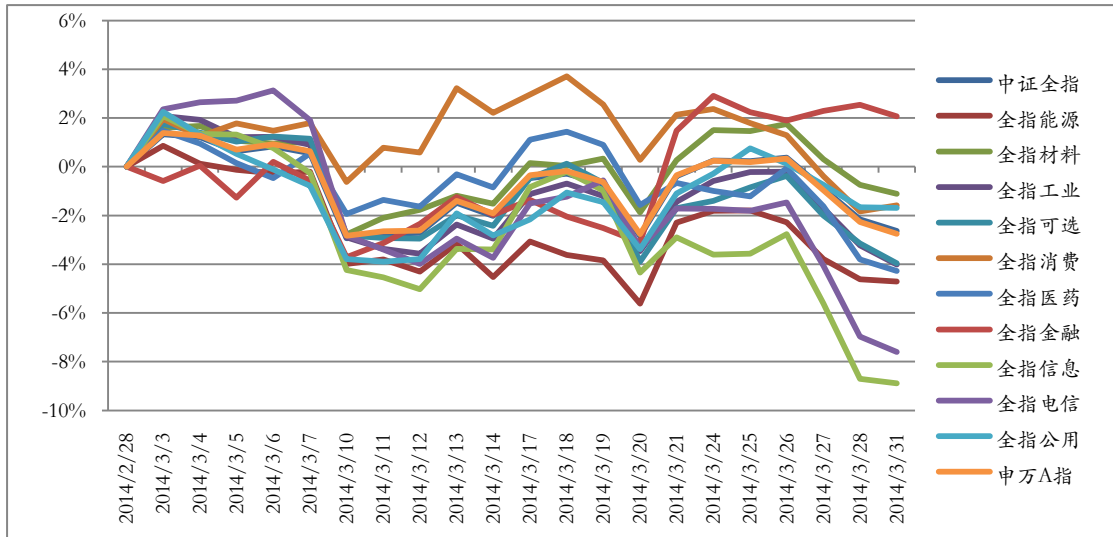
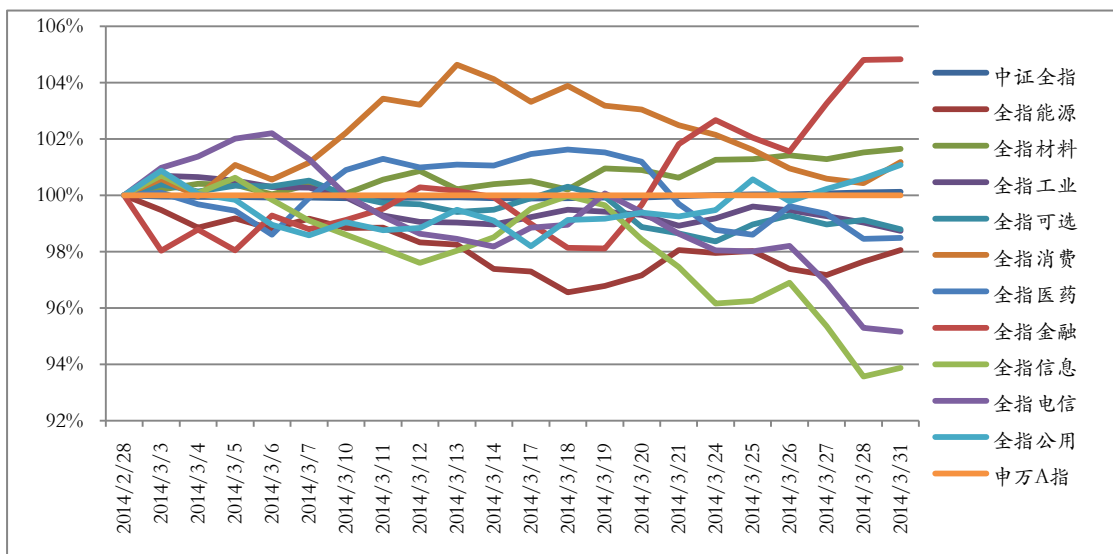


图 8 行业指数本月超额收益对比



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3月份核心指数的估值水平较2月明显回落，市场平均动态（2014年）市盈率为8.97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6.33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	7.14	7.12	6.33	1.13
上证180	7.35	7.30	6.43	1.15
深证成指	13.33	12.99	10.35	1.88
深证100P	16.03	15.21	12.19	1.98
中小板指数	28.03	26.67	19.34	3.37
中小板300	31.38	29.92	20.55	3.22
创业板指P	55.76	53.98	33.59	5.79
沪深300	8.21	8.11	7.09	1.23
中证500	25.93	24.88	17.75	2.28
申万A指	11.30	11.09	8.97	1.52

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	10.12	10.28	9.46	1.18
全指材料	24.21	23.11	16.85	1.63
全指工业	17.54	17.14	13.00	1.65
全指可选	19.42	18.26	13.12	2.31
全指消费	18.72	19.22	15.74	3.00
全指医药	35.65	35.07	26.28	4.26
全指金融	5.89	5.85	5.12	1.03
全指信息	50.10	43.97	27.05	4.05
全指电信	32.97	34.02	20.01	2.02
全指公用	12.19	10.81	9.04	1.39
中证全指	11.22	11.00	8.89	1.51

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	37.56	-2.44	12.86	8.48
600016	民生银行	7.66	1.73	10.90	8.16
600036	招商银行	9.82	-1.11	10.91	7.64
600000	浦发银行	9.72	9.09	37.61	5.13
601166	兴业银行	9.52	4.39	20.23	5.13
贡献前 5 名样本股					
代码	简称	收盘	涨跌幅%	换手率%	贡献点数
600000	浦发银行	9.72	9.09	37.61	6.27
601166	兴业银行	9.52	4.39	20.23	3.16
600383	金地集团	6.92	15.33	23.37	2.85
600104	上汽集团	13.85	9.06	29.75	2.63
600048	保利地产	7.61	12.74	54.91	2.54
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
600383	金地集团	6.92	15.33	23.37	2.85
600048	保利地产	7.61	12.74	54.91	2.54
600549	厦门钨业	23.46	11.87	53.46	0.47
600000	浦发银行	9.72	9.09	37.61	6.27
600104	上汽集团	13.85	9.06	29.75	2.63
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
600406	国电南瑞	14.12	-24.65	54.95	-4.65
600547	山东黄金	16.74	-11.19	57.81	-1.03
601989	中国重工	4.68	-10.00	36.39	-1.88
600637	百视通	32.08	-9.35	33.73	-1.53
600010	宝钢股份	4.02	-8.01	26.87	-0.78

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	37.56	-2.44	12.86	5.37
600016	民生银行	7.66	1.73	10.90	5.17
600036	招商银行	9.82	-1.11	10.91	4.84
600000	浦发银行	9.72	9.09	37.61	3.25
601166	兴业银行	9.52	4.39	20.23	3.25
贡献前 5 名样本股					
代码	简称	收盘	涨跌幅%	换手率%	贡献点数
600000	浦发银行	9.72	9.09	37.61	12.72
600340	华夏幸福	27.84	52.13	98.36	7.09
600352	浙江龙盛	16.26	32.41	53.21	6.77
601166	兴业银行	9.52	4.39	20.23	6.42
600383	金地集团	6.92	15.33	23.37	5.77
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
600340	华夏幸福	27.84	52.13	98.36	7.09
600352	浙江龙盛	16.26	32.41	53.21	6.77
601992	金隅股份	6.47	26.62	111.59	2.46
600747	大连控股	5.49	22.00	45.87	1.49
600376	首开股份	4.90	18.36	94.66	1.17
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
600598	*ST 大荒	6.97	-24.97	72.04	-2.35
600406	国电南瑞	14.12	-24.65	54.95	-9.44
600588	用友软件	17.27	-24.19	57.25	-3.76
600633	浙报传媒	27.36	-21.60	84.19	-1.29
600770	综艺股份	9.15	-21.46	52.50	-2.68

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	8.09	20.39	36.11	9.10
000651	格力电器	28.00	0.90	19.15	8.40
000001	平安银行	10.77	-3.23	25.71	5.88
000333	美的集团	45.08	15.77	23.31	4.32
000858	五粮液	16.67	9.17	46.54	3.88
贡献前 5 名样本股					
代码	简称	收盘	涨跌幅%	换手率%	贡献点数
000002	万科 A	8.09	20.39	36.11	110.79
000333	美的集团	45.08	15.77	23.31	42.30
000858	五粮液	16.67	9.17	46.54	23.43
000024	招商地产	18.86	19.07	81.34	20.75
000402	金融街	5.05	9.78	32.94	10.04
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
000002	万科 A	8.09	20.39	36.11	110.79
000024	招商地产	18.86	19.07	81.34	20.75
000333	美的集团	45.08	15.77	23.31	42.30
000402	金融街	5.05	9.78	32.94	10.04
000858	五粮液	16.67	9.17	46.54	23.43
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
002024	苏宁云商	7.02	-24.92	62.76	-89.75
002415	海康威视	17.45	-20.65	31.97	-56.35
002594	比亚迪	48.11	-15.46	45.31	-31.72
002353	杰瑞股份	60.20	-14.83	27.01	-24.58
000776	广发证券	9.88	-8.09	22.99	-23.91

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	8.09	20.39	36.11	5.63
000651	格力电器	28.00	0.90	19.15	5.20
000001	平安银行	10.77	-3.23	25.71	3.63
000333	美的集团	45.08	15.77	23.31	2.67
000858	五粮液	16.67	9.17	46.54	2.40
贡献前 5 名样本股					
代码	简称	收盘	涨跌幅%	换手率%	贡献点数
000002	万科 A	8.09	20.39	36.11	23.17
000333	美的集团	45.08	15.77	23.31	8.85
000858	五粮液	16.67	9.17	46.54	4.90
002146	荣盛发展	12.35	42.44	207.44	4.82
000024	招商地产	18.86	19.07	81.34	4.34
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
002146	荣盛发展	12.35	42.44	207.44	4.82
000046	泛海建设	5.48	27.44	5.91	2.64
000401	冀东水泥	8.96	21.41	108.47	1.58
000002	万科 A	8.09	20.39	36.11	23.17
000024	招商地产	18.86	19.07	81.34	4.34
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
002024	苏宁云商	7.02	-24.92	62.76	-18.77
300104	乐视网	37.35	-24.39	78.89	-7.36
000400	许继电气	30.65	-21.81	28.01	-7.11
002415	海康威视	17.45	-20.65	31.97	-11.78
000559	万向钱潮	9.57	-20.05	269.15	-3.88

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	7.02	-24.92	62.76	4.74
002415	海康威视	17.45	-20.65	31.97	3.80
002594	比亚迪	48.11	-15.46	45.31	3.04
002241	歌尔声学	25.60	-6.94	46.78	3.03
002230	科大讯飞	45.00	-10.87	34.67	2.56
贡献前 5 名样本股					
代码	简称	收盘	涨跌幅%	换手率%	贡献点数
002146	荣盛发展	12.35	42.44	207.44	18.59
002092	中泰化学	5.83	13.87	47.78	4.93
002129	中环股份	17.58	8.05	60.62	3.19
002001	新和成	19.26	7.12	65.97	3.17
002299	圣农发展	8.74	10.22	36.34	2.52
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
002146	荣盛发展	12.35	42.44	207.44	18.59
002092	中泰化学	5.83	13.87	47.78	4.93
002275	桂林三金	16.62	11.54	57.70	1.96
002299	圣农发展	8.74	10.22	36.34	2.52
002129	中环股份	17.58	8.05	60.62	3.19
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
002396	星网锐捷	24.03	-31.05	102.90	-12.81
002153	石基信息	41.33	-26.59	45.32	-12.29
002052	同洲电子	9.29	-26.44	69.29	-12.54
002091	江苏国泰	13.69	-25.44	182.11	-6.26
002024	苏宁云商	7.02	-24.92	62.76	-72.33

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	7.02	-24.92	62.76	2.64
002415	海康威视	17.45	-20.65	31.97	2.11
002594	比亚迪	48.11	-15.46	45.31	1.69
002241	歌尔声学	25.60	-6.94	46.78	1.69
002230	科大讯飞	45.00	-10.87	34.67	1.42
贡献前 5 名样本股					
代码	简称	收盘	涨跌幅%	换手率%	贡献点数
002146	荣盛发展	12.35	42.44	207.44	2.06
002440	闰土股份	23.13	21.48	120.55	1.21
002437	誉衡药业	53.26	21.10	46.34	0.74
002092	中泰化学	5.83	13.87	47.78	0.55
002701	奥瑞金	43.50	12.84	69.48	0.47
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
002146	荣盛发展	12.35	42.44	207.44	2.06
002440	闰土股份	23.13	21.48	120.55	1.21
002437	誉衡药业	53.26	21.10	46.34	0.74
002421	达实智能	22.31	19.18	90.74	0.45
002342	巨力索具	6.31	17.07	184.29	0.21
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
002396	星网锐捷	24.03	-31.05	102.90	-1.42
002197	证通电子	13.56	-26.70	306.40	-0.48
002153	石基信息	41.33	-26.59	45.32	-1.36
002052	同洲电子	9.29	-26.44	69.29	-1.39
002618	丹邦科技	28.30	-25.99	24.59	-0.58

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	23.78	-2.34	73.45	4.74
300070	碧水源	33.03	-7.50	36.68	3.66
300124	汇川技术	71.03	-2.73	22.11	3.20
300058	蓝色光标	50.00	-5.11	22.08	3.06
300104	乐视网	37.35	-24.39	78.89	2.85
贡献前 5 名样本股					
代码	简称	收盘	涨跌幅%	换手率%	贡献点数
300003	乐普医疗	21.58	21.17	51.40	3.85
300244	迪安诊断	76.80	27.05	38.56	2.83
300020	银江股份	31.58	19.17	52.75	2.62
300059	东方财富	17.58	8.72	74.20	2.06
300212	易华录	47.00	9.30	37.50	1.93
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
300244	迪安诊断	76.80	27.05	38.56	2.83
300003	乐普医疗	21.58	21.17	51.40	3.85
300020	银江股份	31.58	19.17	52.75	2.62
300004	南风股份	48.16	15.49	17.73	1.79
300156	天立环保	11.15	12.40	150.86	0.65
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
300133	华策影视	23.56	-30.71	66.88	-8.19
300104	乐视网	37.35	-24.39	78.89	-12.21
300215	电科院	17.47	-24.04	30.03	-1.95
300096	易联众	18.48	-22.03	53.21	-2.10
300002	神州泰岳	23.45	-21.83	71.95	-5.60

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	37.56	-2.44	12.86	3.75
600016	民生银行	7.66	1.73	10.90	3.61
600036	招商银行	9.82	-1.11	10.91	3.38
600000	浦发银行	9.72	9.09	37.61	2.27
601166	兴业银行	9.52	4.39	20.23	2.27
贡献前 5 名样本股					
代码	简称	收盘	涨跌幅%	换手率%	贡献点数
000002	万科 A	8.09	20.39	36.11	5.94
600000	浦发银行	9.72	9.09	37.61	4.07
600340	华夏幸福	27.84	52.13	98.36	2.26
600352	浙江龙盛	16.26	32.41	53.21	2.16
601166	兴业银行	9.52	4.39	20.23	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
600340	华夏幸福	27.84	52.13	98.36	2.26
002146	荣盛发展	12.35	42.44	207.44	1.23
600352	浙江龙盛	16.26	32.41	53.21	2.16
000046	泛海建设	5.48	27.44	5.91	0.73
601992	金隅股份	6.47	26.62	111.59	0.78
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
600718	东软集团	12.28	-25.67	73.91	-1.64
600598	*ST 大荒	6.97	-24.97	72.04	-0.74
002024	苏宁云商	7.02	-24.92	62.76	-4.62
600406	国电南瑞	14.12	-24.65	54.95	-3.01
600588	用友软件	17.27	-24.19	57.25	-1.19

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	0.00	0.00	0.70
600594	益佰制药	40.95	2.12	14.30	0.62
601929	吉视传媒	12.19	8.55	57.75	0.59
600499	科达机电	19.98	-6.50	29.46	0.58
600570	恒生电子	21.47	5.66	9.62	0.58
贡献前 5 名样本股					
代码	简称	收盘	涨跌幅%	换手率%	贡献点数
000511	烯碳新材	5.14	37.80	233.26	3.41
002440	闰土股份	23.13	21.48	120.55	3.31
601000	唐山港	4.84	60.27	269.15	3.10
600596	新安股份	12.82	24.10	110.17	2.85
000671	阳光城	9.45	29.45	82.52	2.79
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
601000	唐山港	4.84	60.27	269.15	3.10
000511	烯碳新材	5.14	37.80	233.26	3.41
600776	东方通信	11.50	35.93	95.63	2.41
600220	江苏阳光	3.50	32.08	97.21	2.53
000671	阳光城	9.45	29.45	82.52	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
002396	星网锐捷	24.03	-31.05	102.90	-3.98
600699	均胜电子	21.12	-29.97	108.31	-3.65
000997	新大陆	16.95	-29.58	156.87	-5.35
002153	石基信息	41.33	-26.59	45.32	-3.88
000829	天音控股	7.40	-25.55	99.76	-3.03

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	7.66	1.73	10.90	2.01
601318	中国平安	37.56	-2.44	12.86	1.81
600036	招商银行	9.82	-1.11	10.91	1.29
600000	浦发银行	9.72	9.09	37.61	1.13
601166	兴业银行	9.52	4.39	20.23	1.07
贡献前 5 名样本股					
代码	简称	收盘	涨跌幅%	换手率%	贡献点数
000002	万科 A	8.09	20.39	36.11	2.66
600000	浦发银行	9.72	9.09	37.61	1.95
600352	浙江龙盛	16.26	32.41	53.21	1.03
000333	美的集团	45.08	15.77	23.31	1.02
600340	华夏幸福	27.84	52.13	98.36	0.95
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
600155	宝硕股份	8.73	90.61	310.01	0.29
000687	恒天天鹅	5.29	74.59	239.74	0.21
600606	金丰投资	8.90	70.17	80.53	0.28
002180	万力达	15.27	64.19	34.94	0.10
601000	唐山港	4.84	60.27	269.15	0.26
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
002195	海隆软件	35.60	-34.22	162.64	-0.25
300376	易事特	50.11	-33.75	381.75	-0.14
002502	骅威股份	21.16	-32.46	117.46	-0.16
002354	科冕木业	34.74	-32.21	128.55	-0.15
600390	金瑞科技	11.54	-31.76	282.03	-0.24

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。