

广发基金指数月报

(2014年6月3日—2014年6月30日)

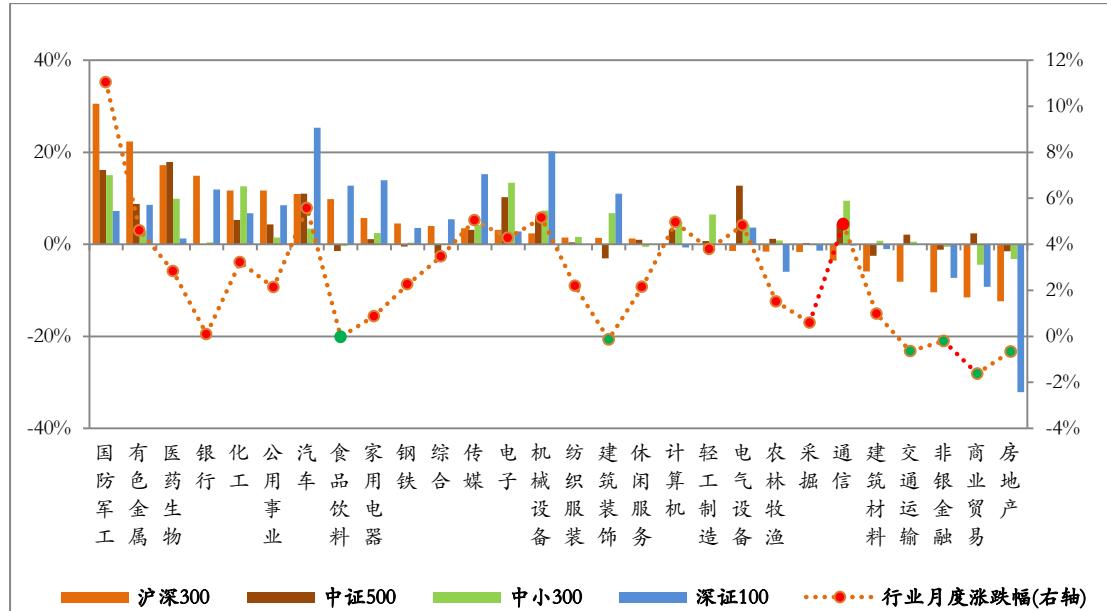
广发基金数量投资部

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

本月市场上涨，申万28个一级行业中商业贸易、房地产、交通运输等6个行业逆势下跌，其余22个行业均上涨，其中国防军工上涨11.04%。从各指数成份股的行业贡献率来看，国防军工行业的上涨对沪深300指数影响最大，贡献率为30.53%；医药生物行业上涨对中证500指数贡献最大，贡献率为17.90%；国防军工行业上涨对中小300指数贡献居首，贡献率为15.07%；汽车行业对深证100指数贡献最大，贡献率为25.35%。

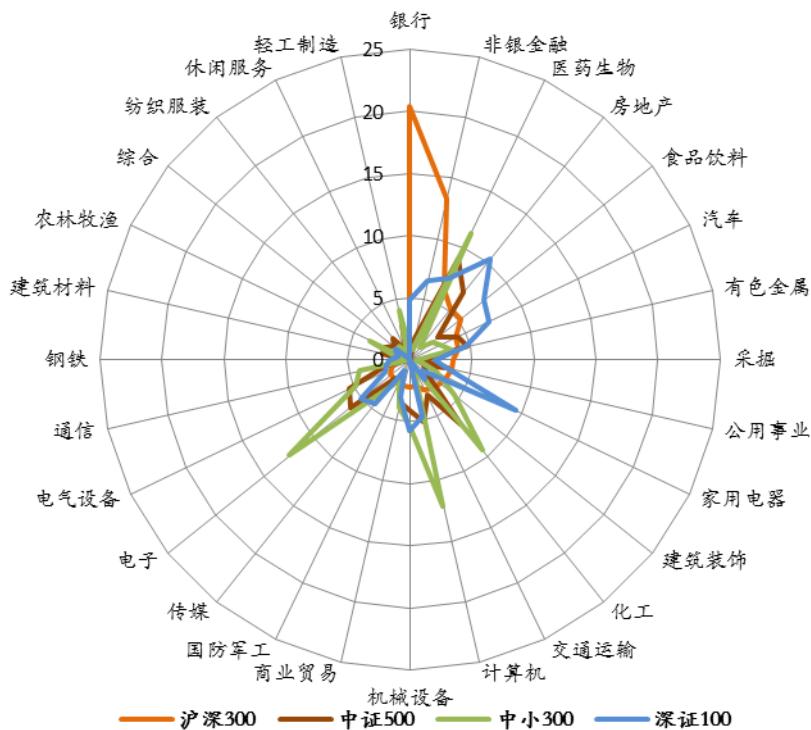
图1 成份行业贡献率与月度涨跌幅



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指数中所占比重居首，为20.39%。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8.99%、6.91%和6.66%。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10.31%、9.50%和7.69%。电子、计算机和医

药生物行业在中小 300 指数中权重居前，分别为 12.41%、12.12% 和 11.35%。

图 2 行业权重分布 (%)



(二) 基金运作情况分析

上月广发中小板 300 联接的年化跟踪误差为 0.28%，中证 500ETF 联接(LOF)、沪深 300 指数、中小板 300ETF、中证 500ETF 和广发深证 100 分级的年化跟踪误差均在 1.2% 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 6 月		2014 年 5 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	0.8699	0.8699	0.8478	0.8478	0.5073	2009/11/26
广发沪深 300	0.976	1.266	0.965	1.255	1.0443	2008/12/30
广发中小板 300ETF	0.955	0.8677	0.9224	0.838	0.2956	2011/6/3
广发中小板 300 联接	0.8696	0.8696	0.8414	0.8414	0.2845	2011/6/9
广发深证 100 分级	0.7574	0.8128	0.7467	0.8021	1.1424	2012/5/7
广发中证 500ETF	1.1058	1.1058	1.076	1.076	0.5282	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

6月沪深两市除深证成指外均上涨，覆盖两市的申万A指上涨2.34%。指数方面，本期核心市场指数中，创业板指涨幅居首，上涨6.57%；而深证成指表现最差，跌幅为0.29%。

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	1482.10	1482.44	1521.96	1459.53	1482.41	0.02%	2469.52
上证180	4711.72	4714.31	4810.35	4632.10	4729.21	0.37%	5502.30
深证成指	7364.83	7365.61	7433.54	7134.54	7343.28	-0.29%	1527.61
深证100P	2461.92	2462.52	2509.09	2404.78	2489.74	1.13%	3193.47
中小板指	4651.80	4654.15	4794.72	4556.45	4794.72	3.07%	2411.97
中小板300	924.61	925.26	955.63	904.54	955.63	3.35%	4821.61
创业板指	1318.13	1317.99	1404.71	1303.36	1404.71	6.57%	2346.79
沪深300	2156.46	2157.64	2196.34	2117.31	2165.12	0.40%	8182.99
中证500	3829.24	3833.12	3925.44	3739.41	3924.90	2.50%	6881.03
申万A指	2078.74	2079.95	2129.95	2041.62	2127.30	2.34%	32042.94

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	1747.33	1745.94	1781.51	1708.99	1764.40	0.98%	800.35
全指材料	1965.30	1965.57	2023.13	1926.38	2022.66	2.92%	3851.33
全指工业	2298.19	2300.23	2370.72	2256.01	2368.72	3.07%	5736.87
全指可选	3525.82	3528.65	3635.18	3451.37	3624.71	2.80%	4343.79
全指消费	5257.37	5257.59	5285.63	5068.00	5276.59	0.37%	1417.49
全指医药	6435.14	6441.35	6617.18	6304.58	6616.98	2.83%	1612.79
全指金融	3206.01	3206.63	3282.21	3151.20	3195.56	-0.33%	2917.97
全指信息	3640.03	3643.04	3808.07	3562.45	3807.74	4.61%	5813.93
全指电信	3405.56	3409.50	3546.10	3299.50	3540.64	3.97%	974.55
全指公用	1608.36	1608.59	1630.26	1574.50	1613.20	0.30%	492.05
中证全指	2812.16	2813.42	2880.38	2761.37	2875.34	2.25%	31154.28

图 3 核心指数月度表现

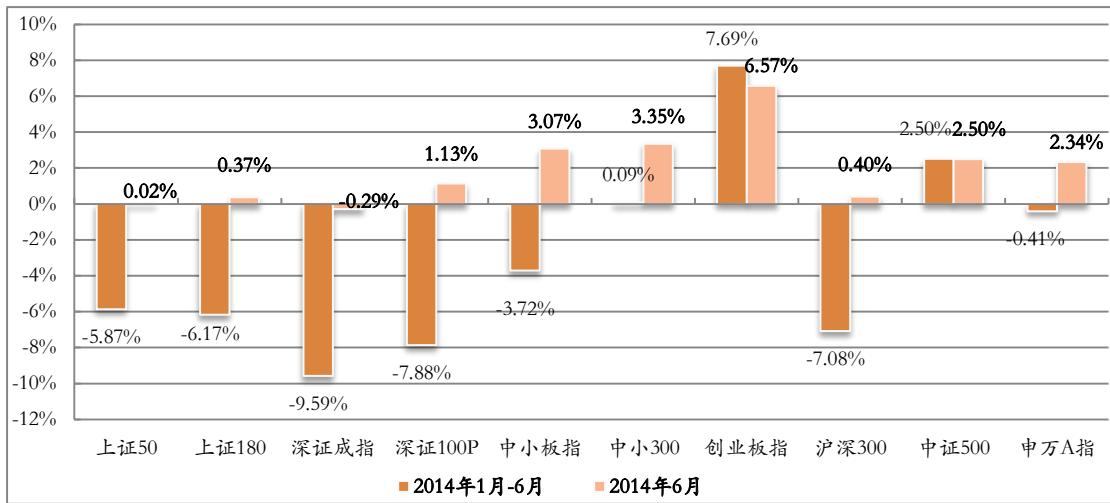


图 4 核心指数本月绝对收益

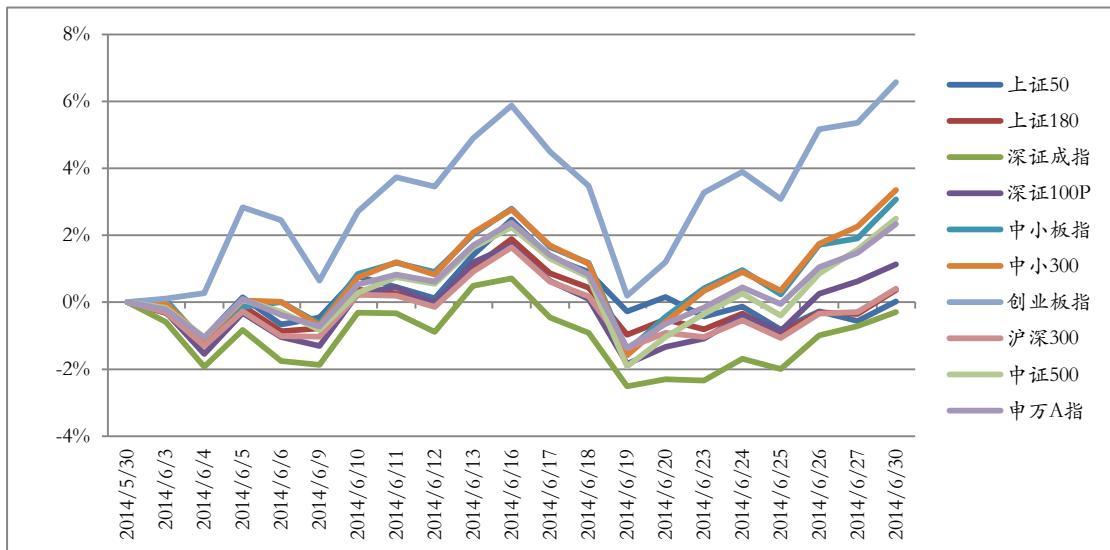
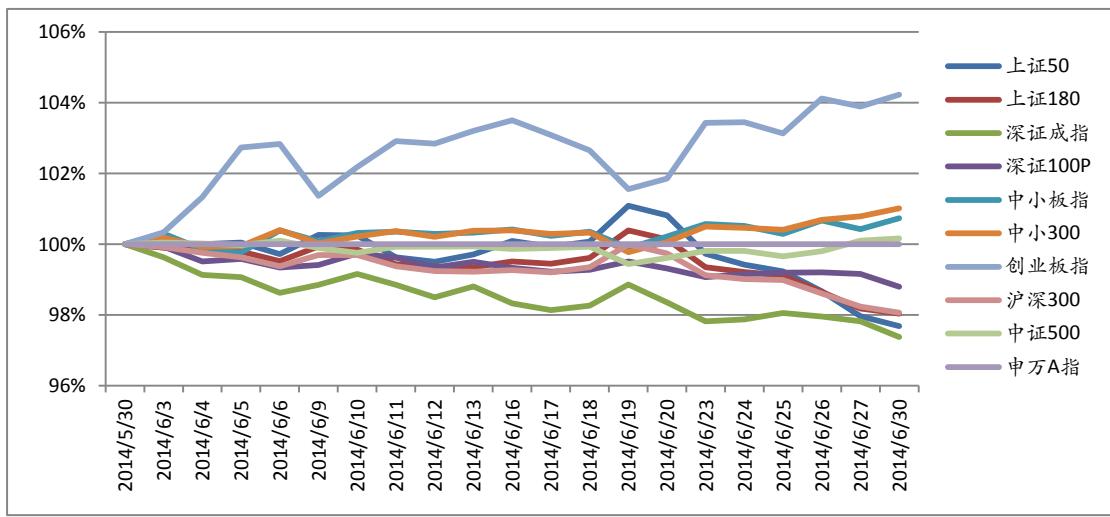


图 5 核心指数本月超额收益对比



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

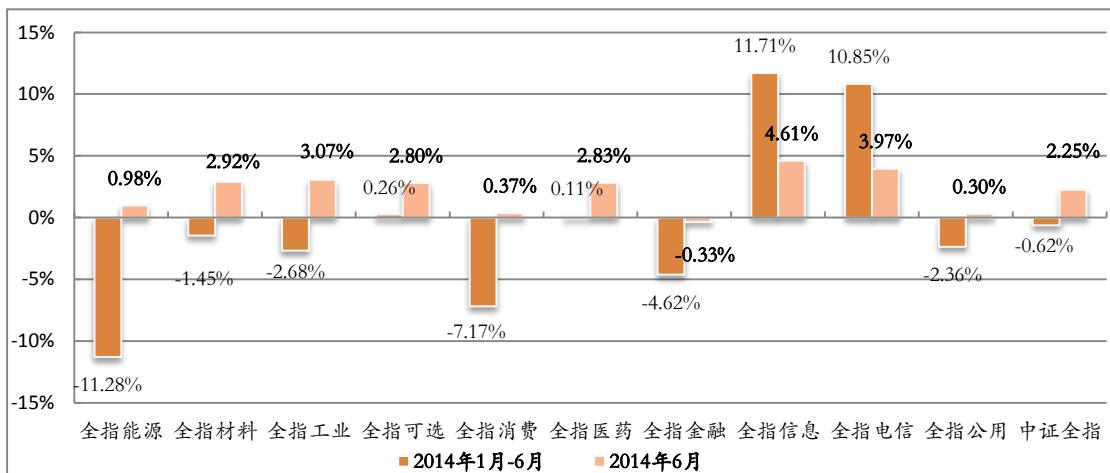


图 7 行业指数本月绝对收益

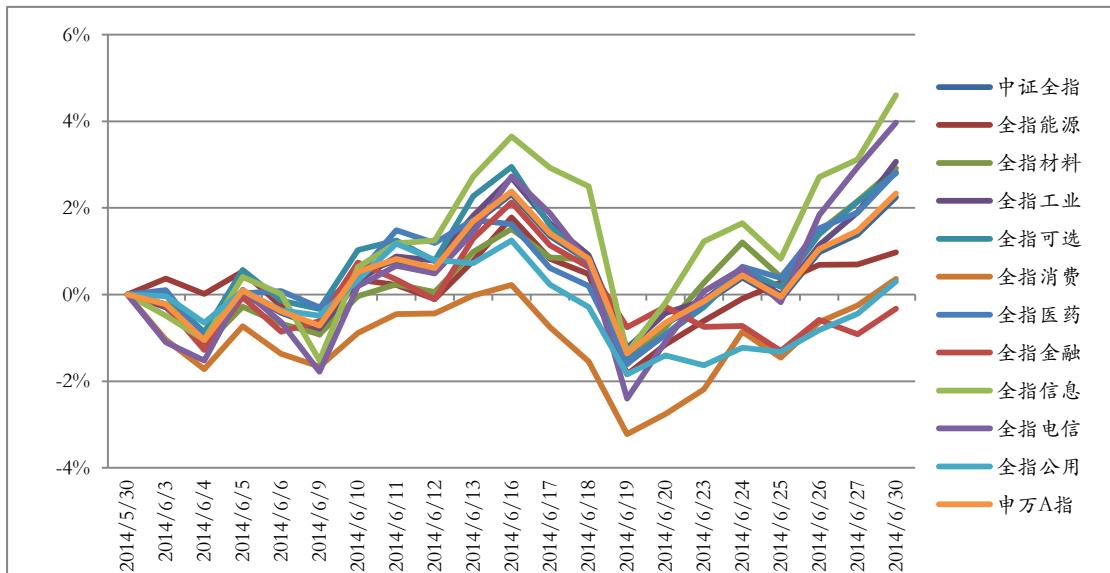
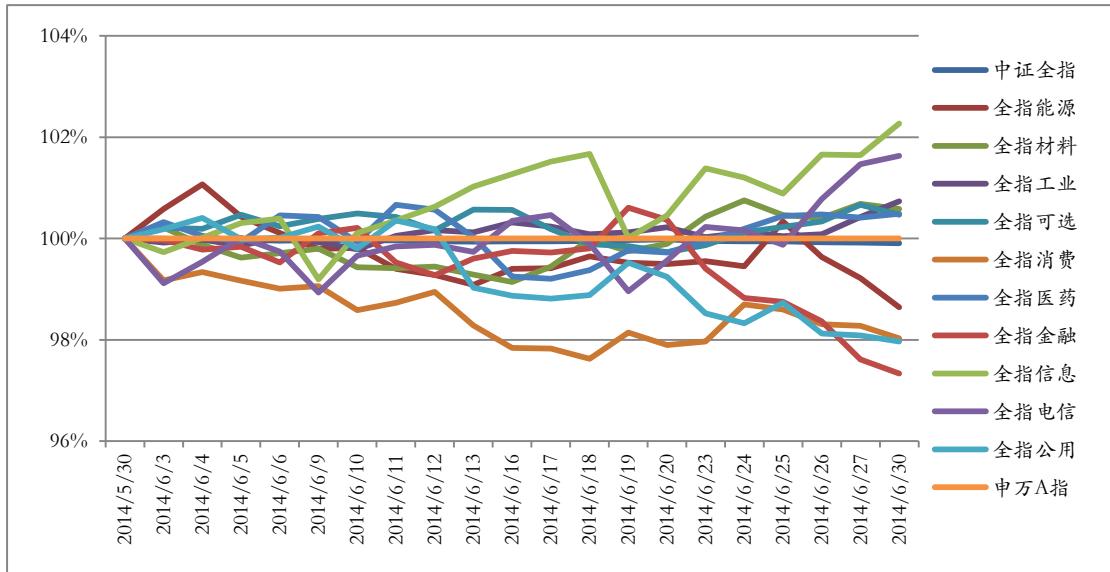


图 8 行业指数本月超额收益对比



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6月份核心指数的估值水平较5月小幅下降，市场平均动态（2014年）市盈率为9.37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6.46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	7.22	7.09	6.46	1.13
上证180	7.43	7.22	6.59	1.16
深证成指	14.27	13.32	11.13	1.89
深证100P	16.99	16.13	13.29	2.00
中小板指数	29.51	27.77	21.09	3.63
中小板300	32.02	30.71	22.24	3.40
创业板指P	58.20	55.59	36.75	5.96
沪深300	8.39	8.15	7.35	1.24
中证500	25.30	24.26	18.37	2.27
申万A指	11.54	11.11	9.37	1.54

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	10.48	10.82	9.96	1.19
全指材料	25.46	24.14	17.57	1.68
全指工业	17.65	16.99	13.92	1.67
全指可选	19.42	17.85	13.65	2.40
全指消费	19.48	19.51	17.19	2.92
全指医药	36.74	35.44	28.69	4.37
全指金融	5.94	5.77	5.22	1.03
全指信息	50.96	48.89	32.03	3.78
全指电信	37.54	32.76	20.53	2.22
全指公用	10.81	10.27	8.92	1.39
中证全指	11.49	11.06	9.33	1.53

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	39.34	-0.22	12.10	8.44
600036	招商银行	10.24	0.89	6.87	7.58
600016	民生银行	6.21	1.36	4.85	7.55
601166	兴业银行	10.03	2.03	10.25	5.14
600000	浦发银行	9.05	1.50	12.59	4.54
贡献前 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	8.89	11.40	11.21	2.38
600519	贵州茅台	141.98	4.73	9.90	1.57
601989	中国重工	4.82	9.70	29.81	1.54
601601	中国太保	17.79	6.02	12.10	1.34
600028	中国石化	5.27	6.47	12.82	0.91
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	8.89	11.40	11.21	2.38
601989	中国重工	4.82	9.70	29.81	1.54
601766	中国南车	4.50	6.64	19.51	0.71
600028	中国石化	5.27	6.47	12.82	0.91
601601	中国太保	17.79	6.02	12.10	1.34
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
601117	中国化学	5.21	-6.96	22.82	-0.52
601901	方正证券	5.43	-3.55	17.78	-0.59
600031	三一重工	5.04	-3.26	9.44	-0.37
600999	招商证券	10.11	-2.51	20.71	-0.52
600887	伊利股份	33.12	-2.44	22.52	-0.71

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	39.34	-0.22	12.10	5.41
600036	招商银行	10.24	0.89	6.87	4.85
600016	民生银行	6.21	1.36	4.85	4.83
601166	兴业银行	10.03	2.03	10.25	3.29
600000	浦发银行	9.05	1.50	12.59	2.91
贡献前 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	8.89	11.40	11.21	4.89
600519	贵州茅台	141.98	4.73	9.90	3.21
601989	中国重工	4.82	9.70	29.81	3.12
600315	上海家化	36.65	13.12	28.30	2.75
601601	中国太保	17.79	6.02	12.10	2.72
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
600516	方大炭素	9.59	29.77	139.40	2.44
600893	航空动力	25.77	18.05	44.08	2.55
600240	华业地产	4.88	16.47	35.58	0.79
600372	中航电子	22.67	14.84	35.47	1.71
600315	上海家化	36.65	13.12	28.30	2.75
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
600770	综艺股份	9.26	-13.94	47.93	-1.76
601633	长城汽车	25.30	-11.69	28.62	-2.02
600759	正和股份	10.22	-8.99	26.42	-1.85
600158	中体产业	9.38	-8.90	116.99	-0.53
600588	用友软件	14.07	-8.64	76.63	-0.75

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	8.27	-3.27	14.75	9.11
000651	格力电器	29.45	-0.06	10.65	8.65
000001	平安银行	9.91	4.87	19.02	6.35
000333	美的集团	19.32	10.91	19.52	4.53
000858	五粮液	17.93	6.85	12.12	4.09
贡献前 5 名样本股					
代码	简称	收盘	涨跌幅%	换手率%	贡献点数
000333	美的集团	19.32	10.91	19.52	32.73
000001	平安银行	9.91	4.87	19.02	21.82
002081	金螳螂	14.16	22.88	49.36	21.12
000858	五粮液	17.93	6.85	12.12	19.25
000768	中航飞机	10.53	14.58	35.99	14.31
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
002081	金螳螂	14.16	22.88	49.36	21.12
000768	中航飞机	10.53	14.58	35.99	14.31
000333	美的集团	19.32	10.91	19.52	32.73
000858	五粮液	17.93	6.85	12.12	19.25
000625	长安汽车	12.31	5.85	27.77	10.44
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
000402	金融街	5.45	-13.22	22.62	-18.51
000538	云南白药	52.20	-9.26	24.57	-20.50
000024	招商地产	10.42	-9.09	36.02	-10.82
002415	海康威视	16.94	-5.99	23.67	-13.40
002024	苏宁云商	6.56	-5.48	51.52	-14.64

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	8.27	-3.27	14.75	5.62
000651	格力电器	29.45	-0.06	10.65	5.34
000001	平安银行	9.91	4.87	19.02	3.92
000333	美的集团	19.32	10.91	19.52	2.79
000858	五粮液	17.93	6.85	12.12	2.52
贡献前 5 名样本股					
代码	简称	收盘	涨跌幅%	换手率%	贡献点数
000333	美的集团	19.32	10.91	19.52	6.84
300024	机器人	29.40	29.05	89.50	6.30
000559	万向钱潮	10.28	35.49	156.79	5.22
000001	平安银行	9.91	4.87	19.02	4.56
300027	华谊兄弟	23.92	13.36	97.40	4.50
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
000559	万向钱潮	10.28	35.49	156.79	5.22
300024	机器人	29.40	29.05	89.50	6.30
002081	金螳螂	14.16	22.88	49.36	4.42
000060	中金岭南	6.80	21.63	41.09	3.16
000839	中信国安	7.60	18.20	38.54	2.26
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
002041	登海种业	27.84	-17.85	49.25	-1.72
000402	金融街	5.45	-13.22	22.62	-3.87
002146	荣盛发展	9.47	-9.63	62.37	-1.34
000538	云南白药	52.20	-9.26	24.57	-4.29
000024	招商地产	10.42	-9.09	36.02	-2.26

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	6.56	-5.48	51.52	4.25
002415	海康威视	16.94	-5.99	23.67	3.53
002241	歌尔声学	26.66	0.15	38.79	3.03
002594	比亚迪	47.49	1.74	26.88	2.88
002450	康得新	22.75	13.07	22.78	2.55
贡献前 5 名样本股					
代码	简称	收盘	涨跌幅%	换手率%	贡献点数
002190	成飞集成	59.00	101.42	416.04	39.59
002081	金螳螂	14.16	22.88	49.36	17.01
002450	康得新	22.75	13.07	22.78	14.13
002230	科大讯飞	26.60	12.24	57.80	12.86
002038	双鹭药业	44.57	9.78	18.49	8.12
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
002190	成飞集成	59.00	101.42	416.04	39.59
002093	国脉科技	6.61	36.57	87.91	4.79
002081	金螳螂	14.16	22.88	49.36	17.01
002091	江苏国泰	15.31	21.70	129.91	3.66
002292	奥飞动漫	36.70	16.43	52.79	7.49
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
002041	登海种业	27.84	-17.85	49.25	-6.61
002277	友阿股份	9.50	-10.46	37.50	-2.95
002146	荣盛发展	9.47	-9.63	62.37	-5.15
002251	步步高	12.88	-7.20	15.09	-1.20
002191	劲嘉股份	13.30	-6.01	31.76	-2.75

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	6.56	-5.48	51.52	2.36
002415	海康威视	16.94	-5.99	23.67	1.96
002241	歌尔声学	26.66	0.15	38.79	1.68
002594	比亚迪	47.49	1.74	26.88	1.60
002450	康得新	22.75	13.07	22.78	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
002190	成飞集成	59.00	101.42	416.04	4.39
002067	景兴纸业	4.53	106.85	290.13	1.92
002081	金螳螂	14.16	22.88	49.36	1.89
002450	康得新	22.75	13.07	22.78	1.57
002230	科大讯飞	26.60	12.24	57.80	1.43
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
002067	景兴纸业	4.53	106.85	290.13	1.92
002190	成飞集成	59.00	101.42	416.04	4.39
002093	国脉科技	6.61	36.57	87.91	0.53
002382	蓝帆股份	20.03	32.69	105.11	0.27
002111	威海广泰	15.25	26.50	70.34	0.42
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
002041	登海种业	27.84	-17.85	49.25	-0.73
002312	三泰电子	20.37	-16.58	79.13	-0.67
002305	南国置业	6.05	-14.91	38.45	-0.25
002635	安洁科技	31.99	-14.58	63.21	-0.30
002407	多氟多	14.28	-11.85	113.44	-0.26

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	23.92	13.36	97.40	4.40
300070	碧水源	29.25	5.34	23.88	3.58
300024	机器人	29.40	29.05	89.50	3.22
300104	乐视网	43.90	7.34	63.98	3.09
300058	蓝色光标	26.54	-1.52	25.48	3.00
贡献前 5 名样本股					
代码	简称	收盘	涨跌幅%	换手率%	贡献点数
300024	机器人	29.40	29.05	89.50	10.19
300027	华谊兄弟	23.92	13.36	97.40	7.28
300002	神州泰岳	15.75	19.50	80.24	4.29
300124	汇川技术	31.20	11.79	34.46	3.82
300202	聚龙股份	27.96	26.08	26.96	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
300037	新宙邦	36.30	31.14	106.80	1.86
300024	机器人	29.40	29.05	89.50	10.19
300202	聚龙股份	27.96	26.08	26.96	3.67
300274	阳光电源	16.51	25.17	58.47	3.18
300291	华录百纳	35.09	21.97	55.83	3.12
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
300146	汤臣倍健	24.65	-18.78	52.86	-4.29
300118	东方日升	7.80	-11.26	51.83	-0.94
300045	华力创通	19.85	-8.69	53.67	-0.68
300168	万达信息	18.35	-6.14	19.20	-1.21
300197	铁汉生态	11.58	-4.30	48.18	-0.23

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	39.34	-0.22	12.10	3.77
600036	招商银行	10.24	0.89	6.87	3.38
600016	民生银行	6.21	1.36	4.85	3.37
601166	兴业银行	10.03	2.03	10.25	2.29
600000	浦发银行	9.05	1.50	12.59	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
600383	金地集团	8.89	11.40	11.21	1.55
000333	美的集团	19.32	10.91	18.22	1.41
000001	平安银行	9.91	4.87	17.25	1.18
000858	五粮液	17.93	6.85	11.48	1.16
600519	贵州茅台	141.98	4.73	9.90	1.03
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
600516	方大炭素	9.59	29.77	139.40	0.81
002081	金螳螂	14.16	22.88	46.12	1.02
000060	中金岭南	6.80	21.63	40.58	0.75
000839	中信国安	7.60	18.20	37.56	0.48
600893	航空动力	25.77	18.05	44.08	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
600827	友谊股份	10.98	-14.95	45.27	-0.64
000402	金融街	5.45	-13.22	21.31	-0.86
601633	长城汽车	25.30	-11.69	28.62	-0.63
002146	荣盛发展	9.47	-9.63	59.38	-0.28
000538	云南白药	52.20	-9.26	23.50	-1.12

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%
600570	恒生电子	29.40	6.06	27.26	0.77
600587	新华医疗	74.55	5.80	16.36	0.55
002190	成飞集成	59.00	101.42	391.91	0.54
600557	康缘药业	28.70	11.13	23.56	0.53
002190	成飞集成	59.00	101.42	391.91	9.29
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	10.28	35.49	137.68	4.23
600790	轻纺城	8.98	46.23	111.42	2.85
000939	凯迪电力	7.40	29.37	39.96	2.62
600557	康缘药业	28.70	11.13	23.56	2.50
002190	成飞集成	59.00	101.42	391.91	9.29
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
600790	轻纺城	8.98	46.23	111.42	2.85
002093	国脉科技	6.61	36.57	86.59	1.24
000559	万向钱潮	10.28	35.49	137.68	4.23
600410	华胜天成	11.89	30.09	174.35	1.89
601519	大智慧	5.87	-18.36	78.35	-1.85
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
600171	上海贝岭	8.16	-18.22	31.91	-2.09
002041	登海种业	27.84	-17.85	39.68	-0.89
600780	通宝能源	4.31	-17.27	30.86	-0.88
002305	南国置业	6.05	-14.91	36.51	-0.63
600387	海越股份	14.13	-11.13	39.62	-1.15

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	6.21	1.36	5.65	1.88
601318	中国平安	39.34	-0.22	13.04	1.82
600036	招商银行	10.24	0.89	7.62	1.37
601166	兴业银行	10.03	2.03	11.95	1.09
600000	浦发银行	9.05	1.50	13.78	1.01
贡献前 5 名样本股					
代码	简称	收盘	涨跌幅%	换手率%	贡献点数
002190	成飞集成	59.00	101.42	416.04	1.12
000333	美的集团	19.32	10.91	19.52	0.78
300024	机器人	29.40	29.05	89.50	0.65
600519	贵州茅台	141.98	4.73	10.34	0.64
000559	万向钱潮	10.28	35.49	156.79	0.56
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
002067	景兴纸业	4.53	106.85	290.13	0.50
002190	成飞集成	59.00	101.42	416.04	1.12
002113	天润控股	19.75	90.45	173.79	0.16
300359	全通教育	71.33	86.24	330.56	0.19
300329	海伦钢琴	17.61	85.76	397.85	0.13
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
000428	华天酒店	4.88	-32.25	100.28	-0.22
000045	深纺织 A	7.32	-25.61	109.49	-0.12
002198	嘉应制药	8.86	-24.34	169.51	-0.12
002363	隆基机械	7.61	-21.82	127.44	-0.04
600708	海博股份	7.18	-21.59	54.13	-0.15

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。