

# 广发基金指数月报

(2014年7月1日—2014年7月31日)

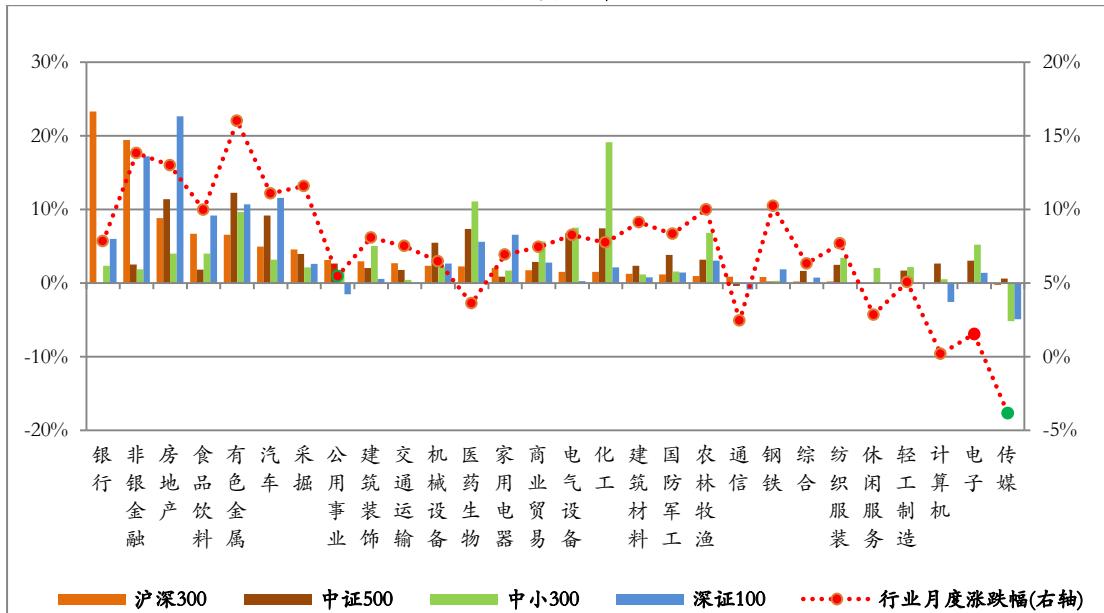
广发基金数量投资部

## 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

本月市场上涨，申万28个一级行业中仅传媒行业逆势下跌，其余27个行业均上涨，其中有色金属上涨16.01%，涨幅最大。从各指数成份股的行业贡献率来看，银行行业的上涨对沪深300指数影响最大，贡献率为23.30%；有色金属行业上涨对中证500指数贡献最大，贡献率为12.29%；化工行业上涨对中小300指数贡献居首，贡献率为19.14%；房地产行业对深证100指数贡献最大，贡献率为22.64%。

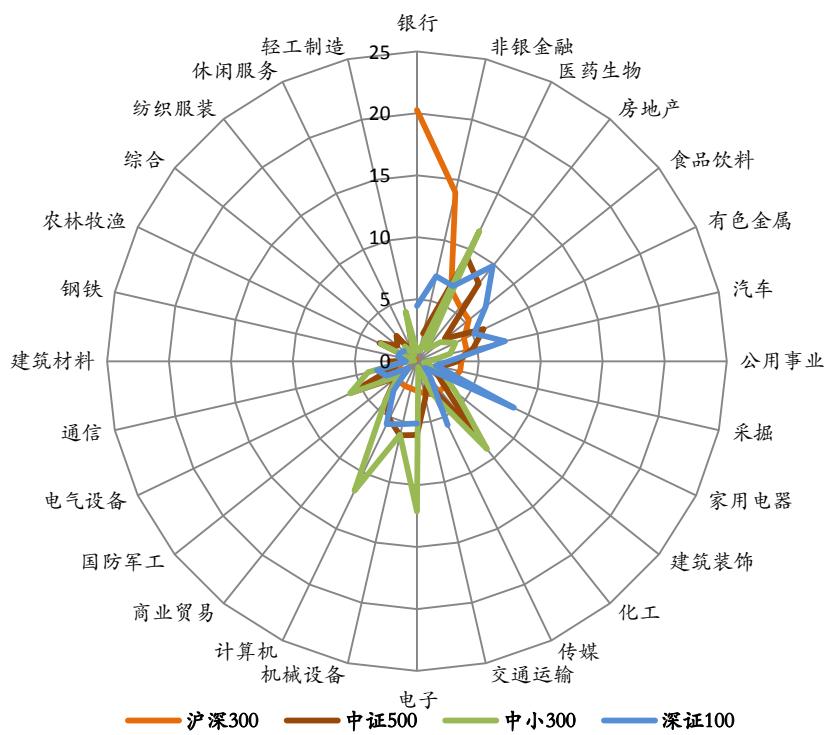
图1 成份行业贡献率与月度涨跌幅



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20.25%。医药生物、房地产和电器设备行业在中证500指数中权重居前，依次为9.30%、8.02%和7.53%。房地产、家用电器和汽车行业在深证100指数中权重位列前三，依次为9.82%、8.68%和7.29%。电子、医药生物和计

算机行业在中小 300 指数中权重居前，分别为 12.11%、11.65% 和 11.60%。

图 2 行业权重分布 (%)



## (二) 基金运作情况分析

上月广发中证 500 联接的年化跟踪误差为 0.26%，广发中小板 300 联接、广发沪深 300、中小板 300ETF、中证 500ETF 和广发深证 100 分级的年化跟踪误差均在 1.3% 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7月		2014年6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	0.9407	0.9407	0.8699	0.8699	0.2576	2009/11/26
广发沪深300	1.068	1.358	0.976	1.266	1.2615	2008/12/30
广发中小板300ETF	0.9991	0.9077	0.955	0.8677	0.6596	2011/6/3
广发中小板300联接	0.9078	0.9078	0.8696	0.8696	0.6154	2011/6/9
广发深证100分级	0.8115	0.8669	0.7574	0.8128	0.4706	2012/5/7
广发中证500ETF	1.2006	1.2006	1.1058	1.1058	0.2948	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

7月沪深两市除创业板指外均上涨，覆盖两市的申万A指上涨7.42%。指数方面，本期核心市场指数中，上证50涨幅居首，上涨9.41%；而创业板指表现最差，跌幅为4.28%。

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	1482.41	1486.79	1622.65	1460.91	1621.85	9.41%	4739.45
上证180	4729.21	4741.73	5156.73	4670.59	5155.06	9.00%	10750.59
深证成指	7343.28	7340.59	7957.46	7146.45	7956.91	8.36%	3048.17
深证100P	2489.74	2490.14	2669.16	2432.88	2668.89	7.20%	6061.19
中小板指	4794.72	4797.60	4950.72	4621.12	4950.72	3.25%	3896.48
中小板300	955.63	956.31	998.78	936.95	998.78	4.52%	7507.53
创业板指	1404.71	1405.44	1428.67	1255.69	1344.54	-4.28%	2718.75
沪深300	2165.12	2169.20	2350.55	2134.80	2350.25	8.55%	15680.08
中证500	3924.90	3927.48	4257.41	3917.53	4257.05	8.46%	12473.05
申万A指	2127.30	2130.28	2285.25	2123.51	2285.25	7.42%	52927.84

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	1764.40	1765.17	1919.92	1716.71	1908.96	8.19%	1379.11
全指材料	2022.66	2024.91	2248.54	2019.70	2248.54	11.17%	7498.56
全指工业	2368.72	2373.12	2548.06	2362.98	2547.66	7.55%	10571.38
全指可选	3624.71	3626.29	3829.96	3600.55	3829.96	5.66%	7091.63
全指消费	5276.59	5272.66	5731.28	5199.29	5730.71	8.61%	2514.98
全指医药	6616.98	6622.23	6830.52	6495.19	6829.82	3.22%	2812.41
全指金融	3195.56	3205.80	3550.90	3157.92	3549.47	11.08%	5886.40
全指信息	3807.74	3811.17	3880.60	3563.78	3823.96	0.43%	7024.56
全指电信	3540.64	3553.45	3690.68	3463.98	3655.04	3.23%	1360.28
全指公用	1613.20	1613.34	1722.49	1607.07	1716.91	6.43%	908.91
中证全指	<b>2875.34</b>	<b>2879.44</b>	<b>3089.15</b>	<b>2869.95</b>	<b>3089.05</b>	<b>7.43%</b>	<b>51611.34</b>

图 3 核心指数月度表现

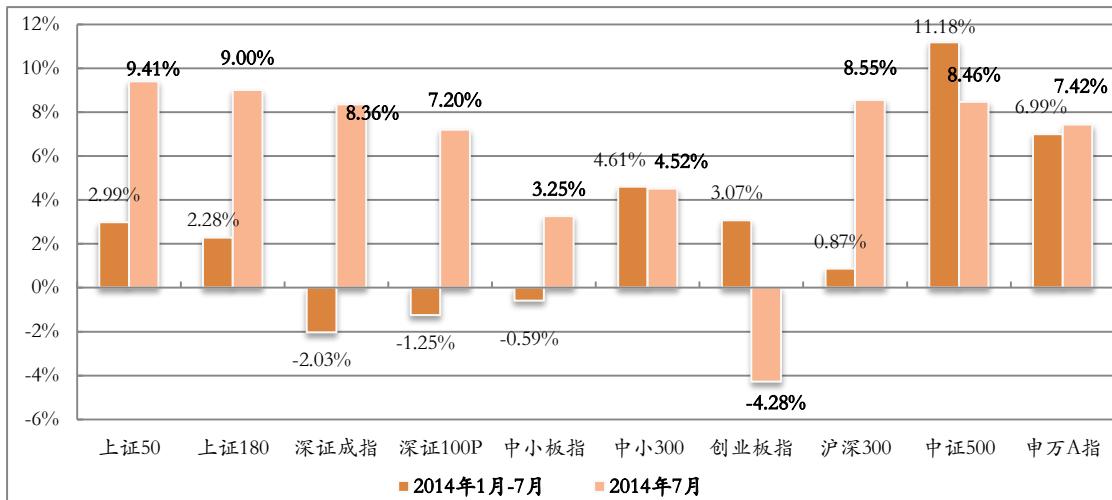


图 4 核心指数本月绝对收益

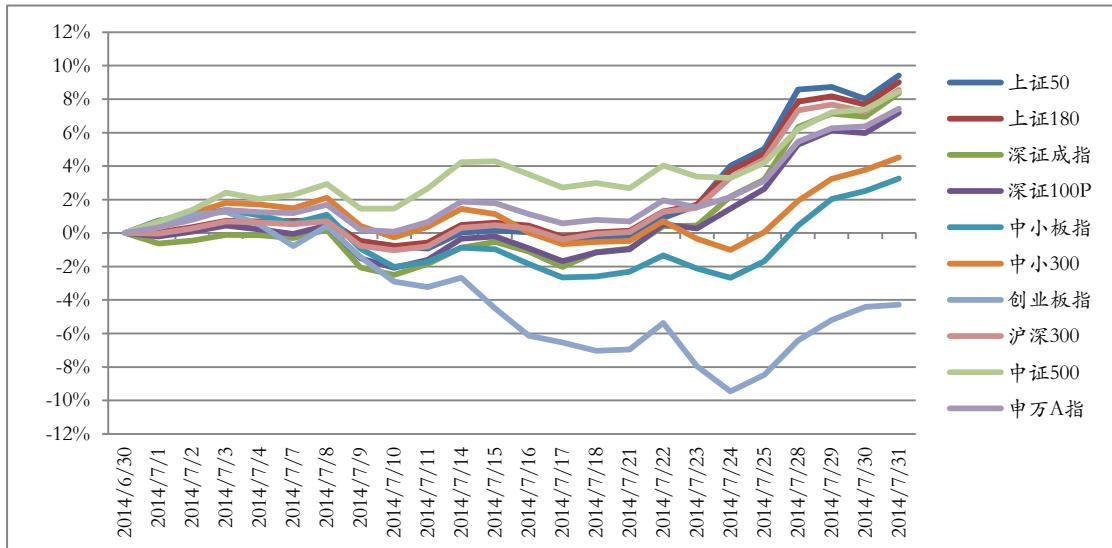
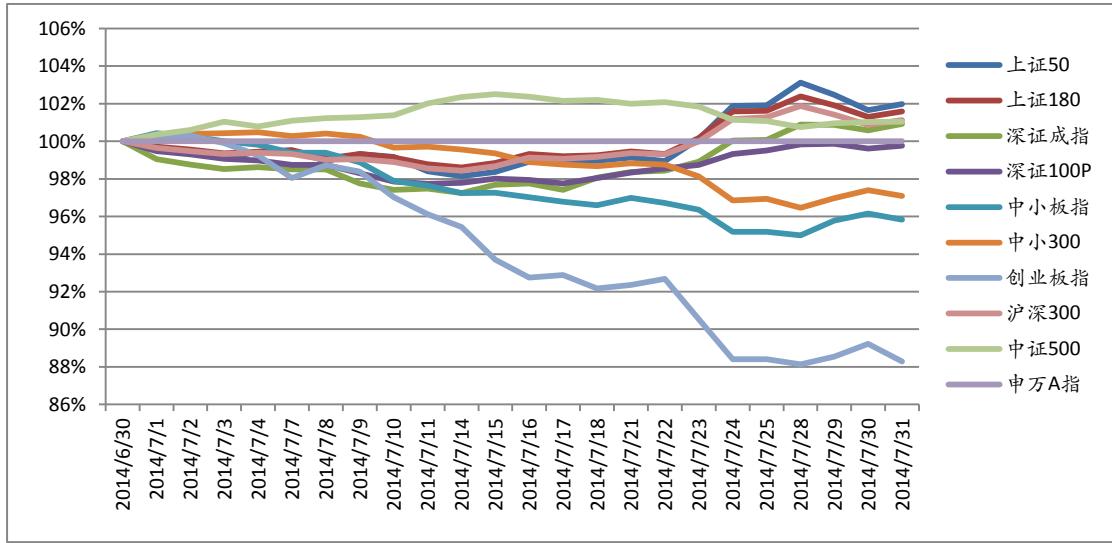


图 5 核心指数本月超额收益对比



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

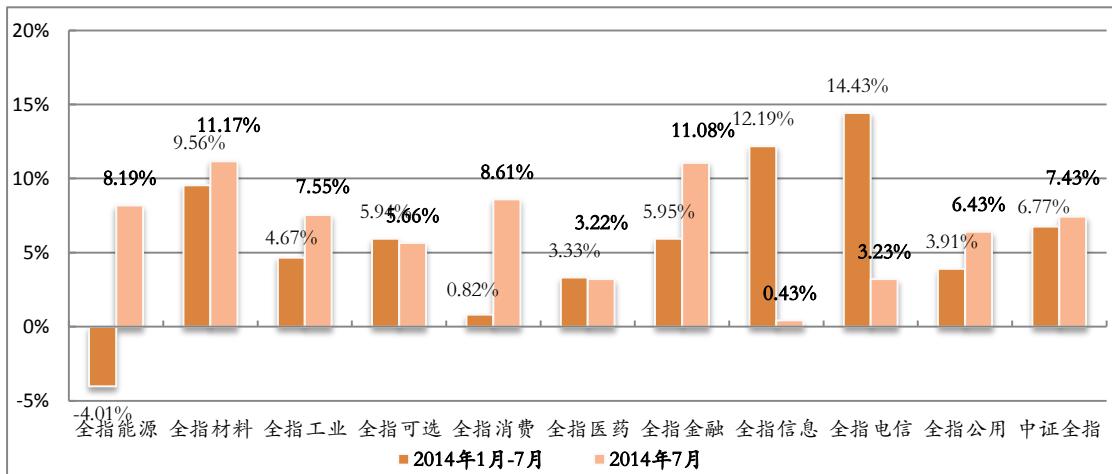


图 7 行业指数本月绝对收益

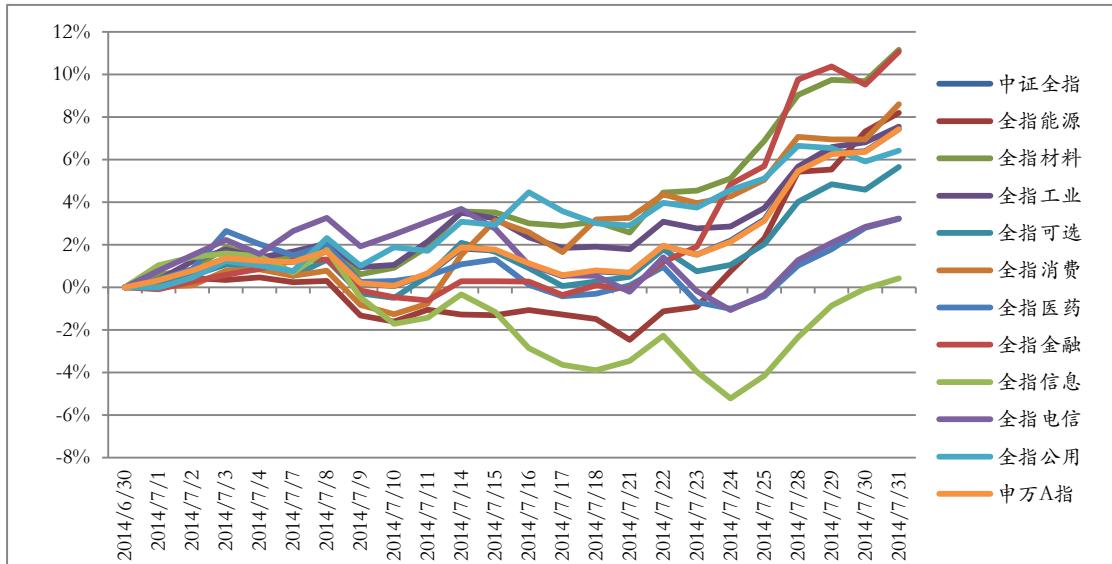
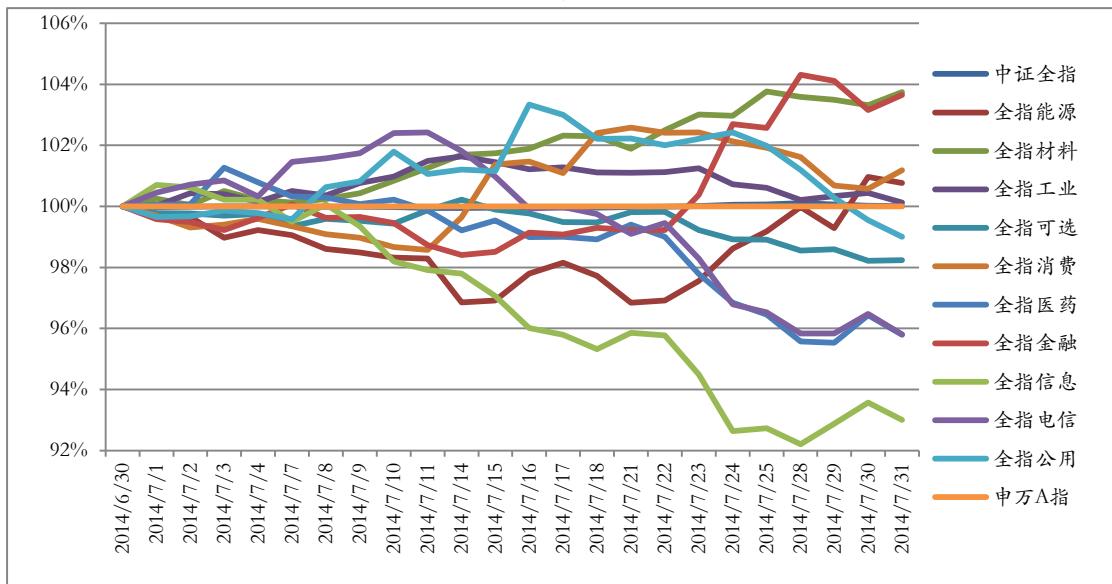


图 8 行业指数本月超额收益对比



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 7 月份核心指数的估值水平较 6 月有所上升，市场平均动态（2014 年）市盈率为 10.03 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 6.93 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	7.74	7.58	6.93	1.23
上证 180	7.94	7.72	7.04	1.27
深证成指	15.44	14.38	11.98	2.06
深证 100P	18.24	17.24	14.18	2.16
中小板指数	30.68	28.30	21.91	3.76
中小板 300	33.54	31.53	23.47	3.53
创业板指 P	55.83	51.98	35.48	5.62
沪深 300	8.98	8.72	7.87	1.36
中证 500	27.37	25.97	20.20	2.45
申万 A 指	12.33	11.85	10.03	1.67

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	11.04	11.39	10.55	1.26
全指材料	28.26	26.58	19.95	1.87
全指工业	18.91	18.26	14.91	1.81
全指可选	20.55	18.84	14.45	2.56
全指消费	21.16	21.31	18.84	3.21
全指医药	37.76	36.27	29.46	4.48
全指金融	6.40	6.21	5.63	1.14
全指信息	51.15	47.89	32.18	3.77
全指电信	38.80	33.54	21.17	2.29
全指公用	11.75	11.17	9.67	1.51
中证全指	<b>12.26</b>	<b>11.78</b>	<b>9.96</b>	<b>1.66</b>

## 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	44.62	13.42	17.19	8.75
600036	招商银行	11.07	15.06	12.10	7.48
600016	民生银行	6.65	7.09	8.85	7.39
601166	兴业银行	11.07	15.76	21.75	5.18
600000	浦发银行	9.80	8.29	21.70	4.49
贡献前 5 名样本股					
代码	简称	收盘	涨跌幅%	换手率%	贡献点数
601318	中国平安	44.62	13.42	17.19	16.79
600036	招商银行	11.07	15.06	12.10	15.90
601166	兴业银行	11.07	15.76	21.75	11.39
601328	交通银行	4.60	27.02	20.79	10.23
600030	中信证券	13.16	14.83	30.53	8.89
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
601328	交通银行	4.60	27.02	20.79	10.23
600887	伊利股份	26.54	23.12	27.69	8.14
600048	保利地产	6.01	21.17	54.52	4.48
601336	新华保险	24.79	18.13	31.01	2.11
601766	中国南车	5.19	17.34	39.45	2.44
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
600703	三安光电	13.92	-10.10	67.21	-1.25
600196	复星医药	18.73	-7.23	45.73	-1.11
600028	中国石化	5.22	-0.95	28.58	-0.19
600637	百视通	31.99	0.00	0.00	0.00
600832	东方明珠	10.98	0.00	0.00	0.00

## 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	44.62	13.42	17.19	5.63
600036	招商银行	11.07	15.06	12.10	4.81
600016	民生银行	6.65	7.09	8.85	4.75
601166	兴业银行	11.07	15.76	21.75	3.34
600000	浦发银行	9.80	8.29	21.70	2.89
贡献前 5 名样本股					
代码	简称	收盘	涨跌幅%	换手率%	贡献点数
601318	中国平安	44.62	13.42	17.19	34.33
600036	招商银行	11.07	15.06	12.10	32.50
601166	兴业银行	11.07	15.76	21.75	23.28
601328	交通银行	4.60	27.02	20.79	20.88
600030	中信证券	13.16	14.83	30.53	18.18
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
600435	北方导航	23.50	91.84	450.07	5.73
600157	永泰能源	4.17	75.95	171.13	5.27
600067	冠城大通	6.74	34.53	101.45	1.98
600418	江淮汽车	13.68	34.12	140.64	4.26
600773	西藏城投	12.86	30.03	215.14	0.92
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
603000	人民网	34.10	-12.99	89.75	-1.92
600703	三安光电	13.92	-10.10	67.21	-2.57
600880	博瑞传播	10.74	-9.29	71.00	-0.97
600196	复星医药	18.73	-7.23	45.73	-2.26
600373	中文传媒	13.18	-5.86	98.73	-0.54

### 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	9.90	19.71	24.09	9.43
000651	格力电器	30.24	2.68	19.63	7.65
000001	平安银行	10.87	9.69	27.57	6.05
000333	美的集团	21.38	10.66	21.75	4.35
000858	五粮液	19.39	12.54	29.25	3.83
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	9.90	19.71	24.09	123.54
000562	宏源证券	11.57	42.49	27.92	51.71
000783	长江证券	6.18	32.18	118.28	45.90
000001	平安银行	10.87	9.69	27.57	42.50
000858	五粮液	19.39	12.54	29.25	33.99
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
000562	宏源证券	11.57	42.49	27.92	51.71
000783	长江证券	6.18	32.18	118.28	45.90
000024	招商地产	12.59	20.82	77.41	21.02
000002	万科 A	9.90	19.71	24.09	123.54
000402	金融街	6.52	19.63	42.56	19.92
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
300104	乐视网	36.79	-16.20	84.33	-22.78
300070	碧水源	26.78	-8.44	32.20	-12.15
002236	大华股份	24.70	-8.35	87.51	-10.82
300027	华谊兄弟	22.43	-6.23	60.06	-10.40
002230	科大讯飞	25.15	-5.45	58.79	-7.72

#### 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	9.90	19.71	24.09	5.82
000651	格力电器	30.24	2.68	19.63	4.72
000001	平安银行	10.87	9.69	27.57	3.73
000333	美的集团	21.38	10.66	21.75	2.69
000858	五粮液	19.39	12.54	29.25	2.37
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	9.90	19.71	24.09	25.58
000562	宏源证券	11.57	42.49	27.92	10.70
000783	长江证券	6.18	32.18	118.28	9.50
000001	平安银行	10.87	9.69	27.57	8.80
000559	万向钱潮	14.82	44.16	365.29	8.19
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	14.82	44.16	365.29	8.19
000562	宏源证券	11.57	42.49	27.92	10.70
000783	长江证券	6.18	32.18	118.28	9.50
000878	云南铜业	9.42	23.78	55.46	2.47
000831	五矿稀土	25.95	23.69	95.90	5.19
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
300104	乐视网	36.79	-16.20	84.33	-4.72
300017	网宿科技	54.08	-15.24	89.08	-3.61
002065	东华软件	17.14	-14.81	22.73	-4.19
300058	蓝色光标	22.77	-14.20	56.66	-3.34
300315	掌趣科技	15.83	-11.37	36.38	-1.74

## 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	7.05	7.47	58.21	4.03
002415	海康威视	18.89	13.19	43.78	3.19
002594	比亚迪	50.71	6.78	38.93	2.72
002241	歌尔声学	26.01	-2.44	51.97	2.57
002450	康得新	24.61	8.18	29.21	2.46
贡献前 5 名样本股					
代码	简称	收盘	涨跌幅%	换手率%	贡献点数
002415	海康威视	18.89	13.19	43.78	18.40
002304	洋河股份	58.68	15.63	28.17	14.57
002024	苏宁云商	7.05	7.47	58.21	13.88
002030	达安基因	20.28	25.22	157.83	10.06
002142	宁波银行	10.05	14.26	31.94	9.22
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
002030	达安基因	20.28	25.22	157.83	10.06
002155	辰州矿业	9.08	21.39	76.48	7.71
002167	东方锆业	13.81	21.25	202.88	5.10
002001	新和成	14.57	17.59	57.46	7.40
002428	云南锗业	14.21	17.15	135.39	5.37
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
002065	东华软件	17.14	-14.81	22.73	-15.83
002148	北纬通信	19.04	-12.66	100.90	-3.28
002063	远光软件	17.99	-12.03	68.32	-5.83
002400	省广股份	21.85	-11.11	42.47	-7.87
002229	鸿博股份	16.00	-10.46	123.01	-2.13

## 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	7.05	7.47	58.21	2.27
002415	海康威视	18.89	13.19	43.78	1.79
002594	比亚迪	50.71	6.78	38.93	1.53
002241	歌尔声学	26.01	-2.44	51.97	1.44
002450	康得新	24.61	8.18	29.21	1.38
贡献前 5 名样本股					
代码	简称	收盘	涨跌幅%	换手率%	贡献点数
002415	海康威视	18.89	13.19	43.78	2.09
002304	洋河股份	58.68	15.63	28.17	1.65
002024	苏宁云商	7.05	7.47	58.21	1.57
002030	达安基因	20.28	25.22	157.83	1.14
002108	沧州明珠	19.11	53.23	174.79	1.13
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
002407	多氟多	22.48	57.42	264.17	1.10
002108	沧州明珠	19.11	53.23	174.79	1.13
002629	仁智油服	10.20	33.83	230.99	0.42
002306	湘鄂情	7.41	33.03	35.76	0.76
002016	世荣兆业	8.00	31.58	130.48	0.34
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
002065	东华软件	17.14	-14.81	22.73	-1.80
002439	启明星辰	18.67	-12.72	49.49	-0.51
002148	北纬通信	19.04	-12.66	100.90	-0.37
002174	游族网络	48.23	-12.36	88.25	-0.24
002063	远光软件	17.99	-12.03	68.32	-0.66

## 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	22.43	-6.23	60.06	3.92
300070	碧水源	26.78	-8.44	32.20	3.30
300024	机器人	28.30	-3.74	81.38	3.04
300104	乐视网	36.79	-16.20	84.33	2.95
300058	蓝色光标	22.77	-14.20	56.66	2.57
贡献前 5 名样本股					
代码	简称	收盘	涨跌幅%	换手率%	贡献点数
300001	特锐德	20.45	50.81	97.62	3.60
300146	汤臣倍健	27.81	12.82	77.14	2.30
300157	恒泰艾普	14.80	14.37	15.02	2.07
300079	数码视讯	12.05	10.55	84.30	2.02
300257	开山股份	35.30	12.52	23.07	1.97
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
300001	特锐德	20.45	50.81	97.62	3.60
300183	东软载波	43.98	22.17	88.42	1.85
300355	蒙草抗旱	15.02	16.72	85.98	1.33
300014	亿纬锂能	18.27	15.85	259.94	1.46
300037	新宙邦	41.70	14.88	156.27	1.24
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
300083	劲胜精密	17.36	-19.40	111.48	-1.17
300043	互动娱乐	15.32	-17.37	96.92	-1.92
300251	光线传媒	18.56	-16.32	109.68	-3.28
300104	乐视网	36.79	-16.20	84.33	-7.67
300088	长信科技	16.39	-15.91	134.85	-2.81

## 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	44.62	13.42	17.19	3.94
600036	招商银行	11.07	15.06	12.10	3.37
600016	民生银行	6.65	7.09	8.85	3.32
601166	兴业银行	11.07	15.76	21.75	2.33
600000	浦发银行	9.80	8.29	21.70	2.02
贡献前 5 名样本股					
代码	简称	收盘	涨跌幅%	换手率%	贡献点数
601318	中国平安	44.62	13.42	17.19	10.95
600036	招商银行	11.07	15.06	12.10	10.37
601166	兴业银行	11.07	15.76	21.75	7.44
000002	万科 A	9.90	19.71	24.09	6.83
601328	交通银行	4.60	27.02	20.79	6.67
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
600157	永泰能源	4.17	75.95	171.13	1.62
601918	国投新集	4.06	45.52	221.35	0.54
000562	宏源证券	11.57	42.49	27.92	2.37
000783	长江证券	6.18	32.18	118.28	2.17
000961	中南建设	8.38	30.68	93.23	0.30
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
002065	东华软件	17.14	-14.81	22.73	-0.94
603000	人民网	34.10	-12.99	89.75	-0.62
002400	省广股份	21.85	-11.11	42.47	-0.54
600703	三安光电	13.92	-10.10	67.21	-0.82
600880	博瑞传播	10.74	-9.29	71.00	-0.31

## 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%
000559	万向钱潮	14.82	44.16	365.29	0.69
600570	恒生电子	28.81	-2.01	28.50	0.69
600418	江淮汽车	13.68	34.12	140.64	0.60
000511	烯碳新材	9.61	42.58	357.59	0.54
000559	万向钱潮	14.82	44.16	365.29	8.98
贡献前 5 名样本股					
代码	简称	收盘	涨跌幅%	换手率%	贡献点数
600435	北方导航	23.50	91.84	450.07	8.65
000511	烯碳新材	9.61	42.58	357.59	6.82
600418	江淮汽车	13.68	34.12	140.64	6.49
600490	鹏欣资源	8.68	42.06	72.98	4.68
600435	北方导航	23.50	91.84	450.07	8.65
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
000031	中粮地产	5.23	61.90	197.79	3.72
000603	盛达矿业	18.13	53.51	205.06	1.35
601777	力帆股份	9.50	48.67	178.84	1.93
000559	万向钱潮	14.82	44.16	365.29	8.98
600776	东方通信	11.35	-14.58	55.17	-1.53
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
601515	东风股份	10.39	-12.54	91.50	-0.69
600566	洪城股份	20.22	-12.47	29.70	-0.94
002063	远光软件	17.99	-12.03	68.32	-1.88
601011	宝泰隆	11.45	-11.99	74.37	-0.52
600587	新华医疗	33.67	-9.52	48.70	-2.04

## 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	44.62	13.42	17.19	1.91
600016	民生银行	6.65	7.09	8.85	1.87
600036	招商银行	11.07	15.06	12.10	1.37
601166	兴业银行	11.07	15.76	21.75	1.11
600000	浦发银行	9.80	8.29	21.70	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
601318	中国平安	44.62	13.42	17.19	5.18
600036	招商银行	11.07	15.06	12.10	4.10
601328	交通银行	4.60	27.02	20.79	3.90
601166	兴业银行	11.07	15.76	21.75	3.45
600887	伊利股份	26.54	23.12	27.69	3.26
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
600435	北方导航	23.50	91.84	450.07	0.96
000151	中成股份	14.64	91.12	265.23	0.24
002366	丹甫股份	33.15	86.97	406.79	0.33
002640	百圆裤业	28.10	86.59	127.92	0.10
600157	永泰能源	4.17	75.95	171.13	0.89
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
000670	舜元实业	9.20	-50.03	242.04	0.05
002067	景兴纸业	3.56	-21.41	353.39	-0.21
300083	劲胜精密	17.36	-19.40	111.48	-0.09
002113	天润控股	16.01	-18.94	252.74	-0.06
300078	中瑞思创	22.10	-18.78	76.58	-0.06

## 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。