

# 广发基金指数月报

(2014年12月1日—2014年12月31日)

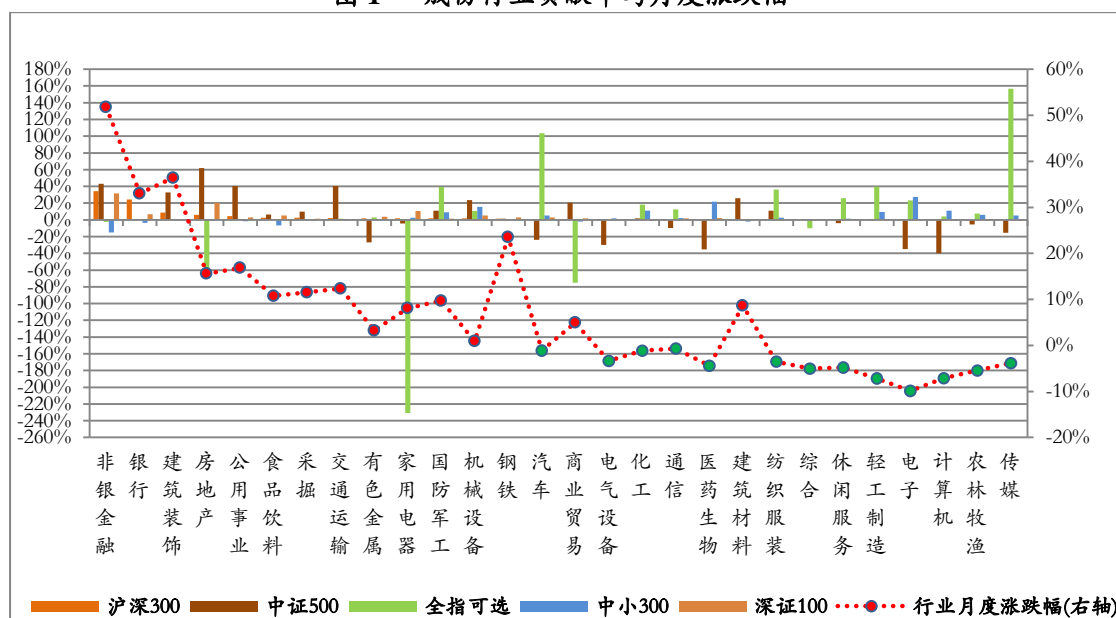
广发基金数量投资部

## 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

本月市场表现分化严重，申万 28 个一级行业涨跌互现，其中非银金融本月上涨 51.76%，涨幅最大。从各指数成份股的行业贡献率来看，非银金融行业的上涨对沪深 300 指数影响最大，贡献率为 34.27%；房地产行业上涨对中证 500 指数贡献最大，贡献率为 61.69%；传媒对全指可选指数的贡献最大，贡献率为 156.77%；电子对中小 300 指数贡献居首，贡献率为 27.43%；非银金融行业对深证 100 指数贡献最大，贡献率为 31.74%。

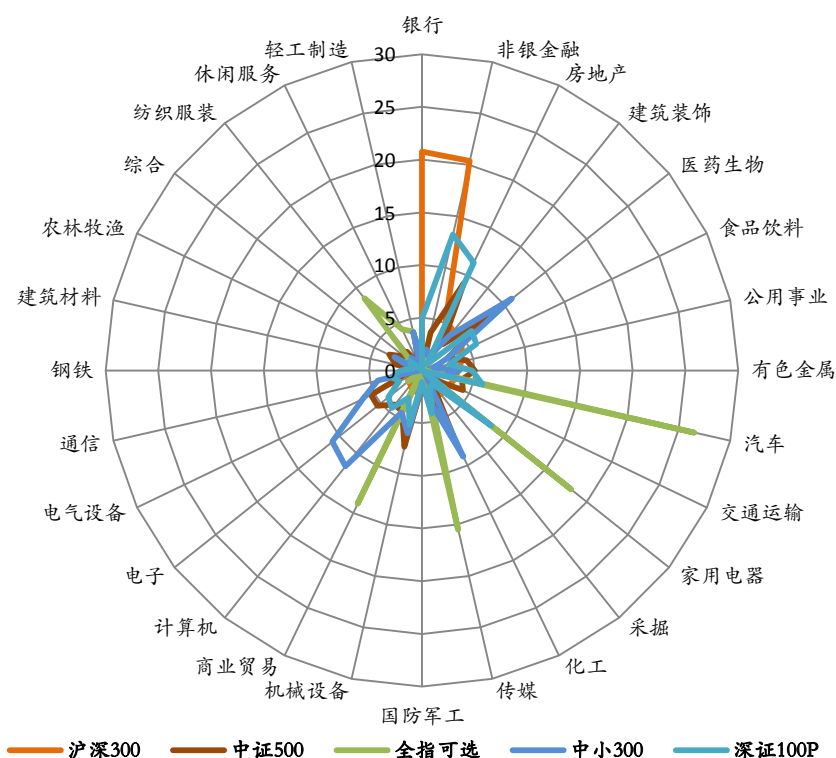
图 1 成份行业贡献率与月度涨跌幅



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 20.76%。房地产、医药生物和机械设备行业在中证 500 指数中权重居前，依次为 9.20%、8.03%和 7.42%。汽车、家用电器、传媒在全指可选指数中权重较大，分别为 26.51%、18.11%、15.49%。计算机、医药生物、电子在

中小 300 指数中权重居前，分别为 11.62%、11.54%和 11.41%。非银金融、房地产、家用电器在深证 100 指数中权重位列前三，依次为 13.24%、11.35%和 8.39%。

图 2 行业权重分布 (%)



## (二) 基金运作情况分析

上月广发中小板 300ETF 的年化跟踪误差为 0.50%。除广发深证 100 分级外，广发中证 500 联接、广发沪深 300、广发中小板 300 联接、广发全指可选消费 ETF 的年化跟踪误差均在 1.5% 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 12 月		2014 年 11 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	1.1573	1.1573	1.1462	1.1462	0.7664	2009/11/26
广发沪深 300	1.565	1.855	1.261	1.551	1.4651	2008/12/30
广发中小板 300ETF	1.1021	1.0013	1.1526	1.0472	0.5043	2011/6/3
广发中小板 300 联接	0.9925	0.9925	1.0384	1.0384	0.6925	2011/6/9
广发深证 100 分级	1.0557	1.1111	0.9195	0.9749	2.7685	2012/5/7

广发中证 500ETF	1.4936	1.4936	1.4772	1.4772	0.8010	2013/4/11
广发全指可选消费 ETF	1.2551	1.2551	1.2547	1.2547	1.0084	2014/6/3

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

12 月沪深两市有涨有跌，覆盖两市的申万 A 指上涨 9.93%。指数方面，本期核心市场指数中，上证 50 涨幅居首，上涨 34.85%；而创业板指表现最差，下跌 6.31%

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	1914.44	1936.81	2590.09	1909.37	2581.57	34.85%	44899.67
上证 180	6222.95	6268.63	8067.97	6197.75	8044.51	29.27%	75198.41
深证成指	9002.23	9029.64	11050.85	9027.30	11014.62	22.35%	13397.39
深证 100P	3068.25	3073.07	3630.89	3065.30	3575.30	16.53%	23572.63
中小板指	5587.20	5578.65	5898.03	5380.07	5461.19	-2.26%	8274.94
中小板 300	1158.11	1156.34	1202.52	1092.37	1107.18	-4.40%	14621.58
创业板指	1570.85	1569.65	1674.98	1450.05	1471.76	-6.31%	5021.53
沪深 300	2808.82	2825.61	3542.34	2804.29	3533.71	25.81%	100169.76
中证 500	5245.27	5246.43	5609.68	5151.00	5322.71	1.48%	32314.34
申万 A 指	2815.12	2823.00	3127.71	2792.91	3094.69	9.93%	180169.45

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	2092.49	2089.20	2464.89	2086.56	2343.53	12.00%	5986.85
全指材料	2698.47	2694.78	2911.09	2676.58	2803.18	3.88%	17957.52
全指工业	3316.38	3319.21	3861.94	3279.08	3673.62	10.77%	38586.43
全指可选	4505.45	4505.16	4838.94	4459.44	4537.22	0.71%	15277.20
全指消费	6287.95	6292.67	6802.97	6281.60	6656.00	5.85%	7803.63
全指医药	7762.94	7770.72	8063.63	7323.91	7445.90	-4.08%	5731.90
全指金融	4471.66	4526.85	6176.49	4422.32	6162.51	37.81%	54930.31
全指信息	4707.77	4707.66	4954.47	4319.00	4388.26	-6.79%	11830.78
全指电信	4477.57	4484.20	4761.22	4269.72	4324.66	-3.42%	2762.58
全指公用	2268.73	2272.71	2869.35	2252.30	2791.31	23.03%	6427.51
中证全指	<b>3801.61</b>	<b>3812.67</b>	<b>4253.18</b>	<b>3772.88</b>	<b>4219.00</b>	<b>10.98%</b>	<b>174459.61</b>

图3 核心指数月度表现

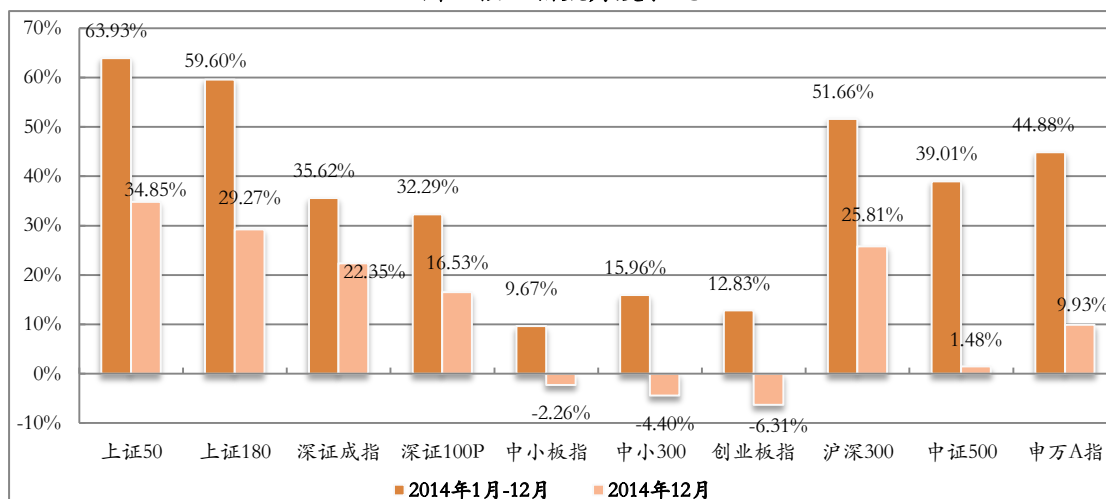


图4 核心指数本月绝对收益

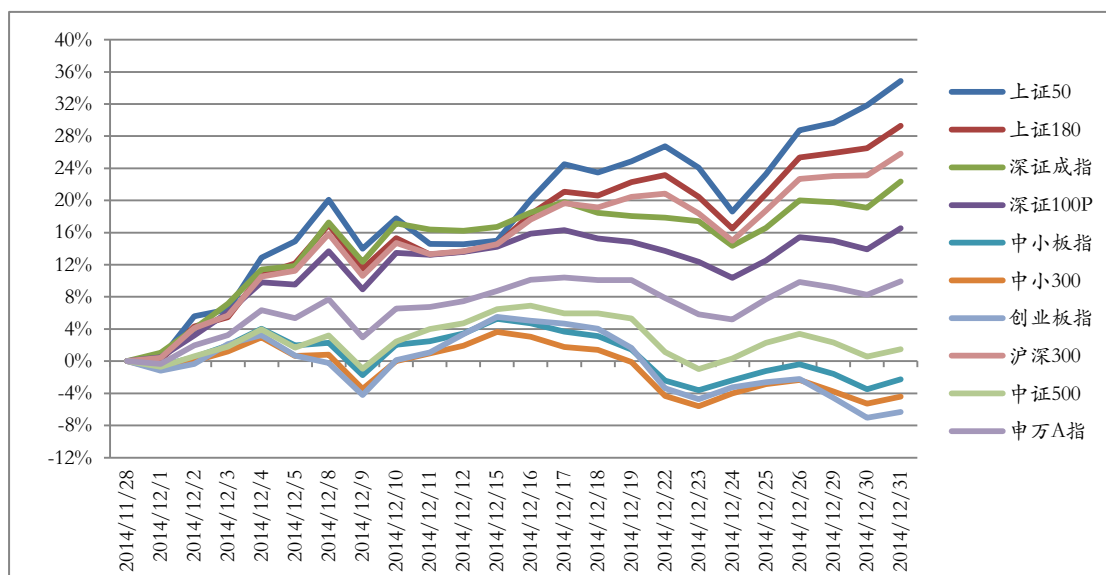
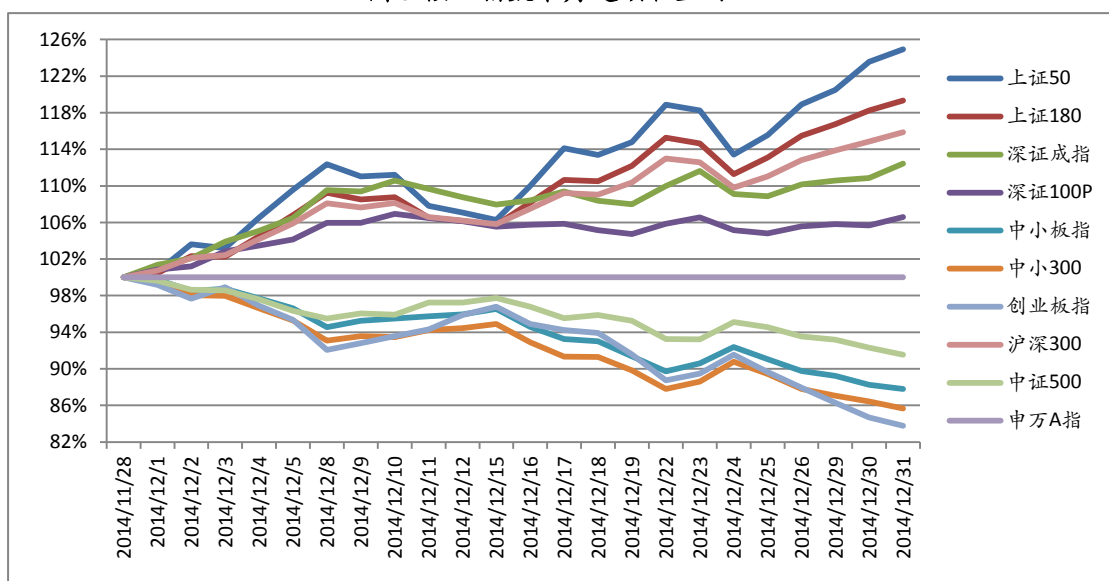


图5 核心指数本月超额收益对比



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

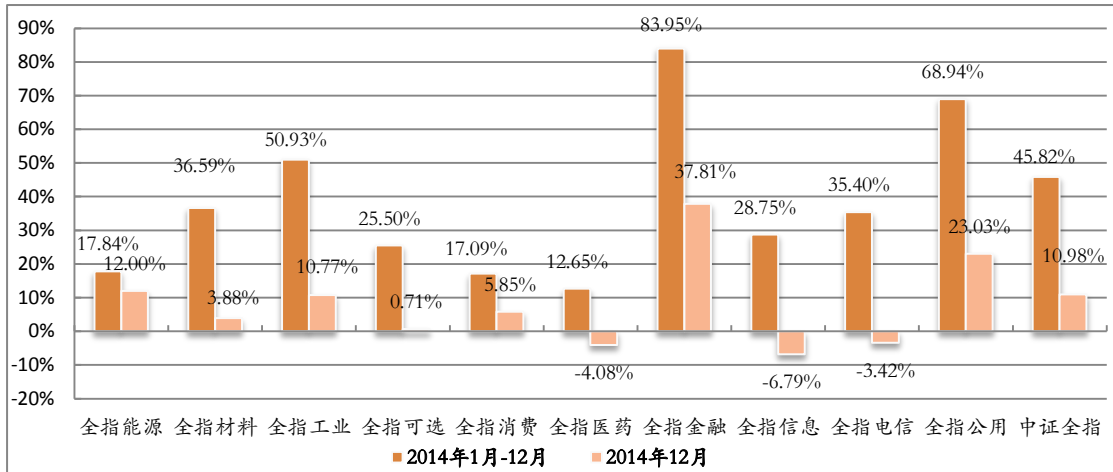


图 7 行业指数本月绝对收益

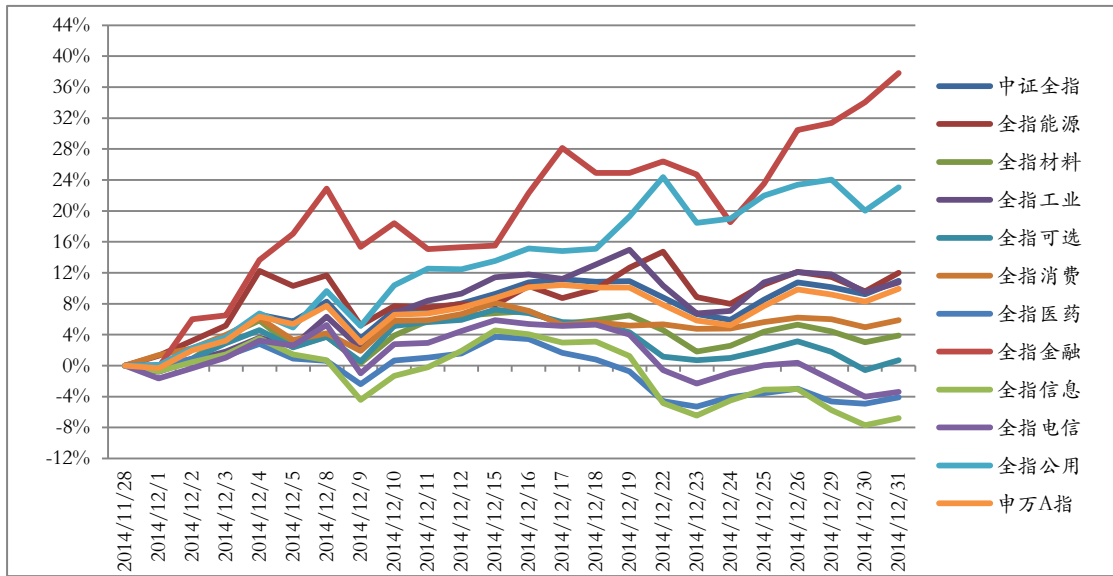
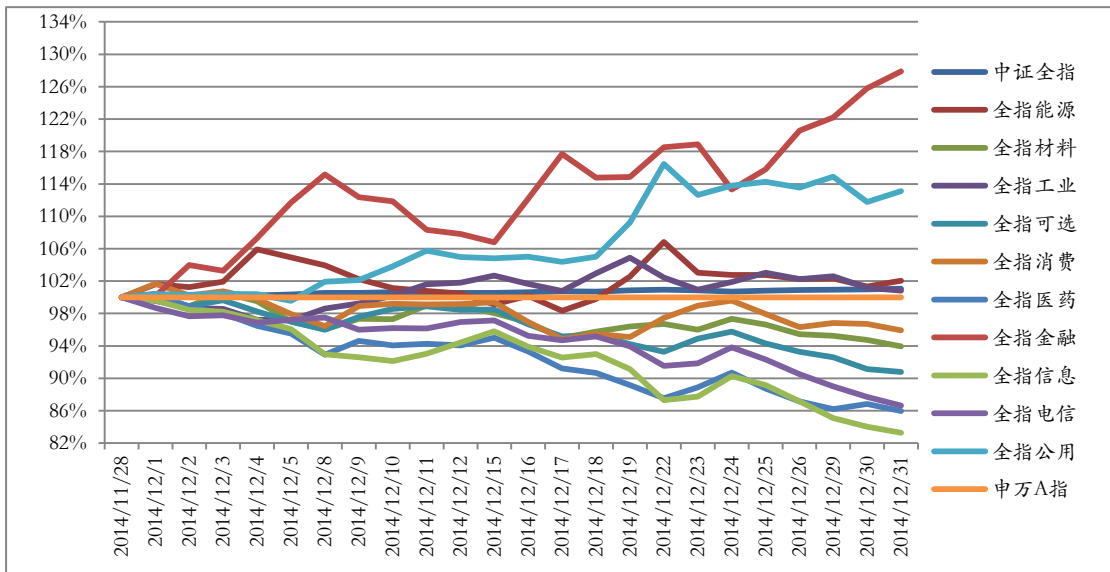


图 8 行业指数本月超额收益对比



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12月份核心指数的估值水平较11月有所上升，市场平均动态（2014年）市盈率为14.85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10.58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	11.71	10.84	10.58	1.67
上证180	12.43	11.46	11.09	1.74
深证成指	20.73	18.07	16.31	2.71
深证100P	24.68	21.79	19.55	2.82
中小板指数	35.71	30.10	26.57	3.89
中小板300	38.73	34.10	29.10	3.70
创业板指P	63.39	53.71	43.14	5.96
沪深300	13.84	12.75	12.29	1.87
中证500	34.53	31.43	27.40	2.87
申万A指	17.71	16.10	14.85	2.16

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	14.44	14.88	15.27	1.59
全指材料	36.84	31.43	27.93	2.22
全指工业	28.81	26.70	23.81	2.60
全指可选	24.43	20.77	17.43	2.78
全指消费	24.91	25.01	22.94	3.52
全指医药	41.76	37.20	33.46	4.44
全指金融	10.81	9.87	9.48	1.64
全指信息	61.58	51.34	41.92	4.45
全指电信	59.87	47.12	35.43	3.15
全指公用	19.60	17.18	15.98	2.27
<b>中证全指</b>	<b>17.63</b>	<b>16.02</b>	<b>14.73</b>	<b>2.14</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	74.71	50.53	134.72	9.18
600016	民生银行	10.88	48.43	110.47	7.57
600036	招商银行	16.59	36.54	99.28	7.03
600030	中信证券	33.90	96.41	276.77	6.85
600837	海通证券	24.06	66.39	234.19	5.00
贡献前 5 名样本股					
代码	简称	收盘	涨跌幅%	换手率%	贡献点数
600030	中信证券	33.90	96.41	276.77	86.86
601318	中国平安	74.71	50.53	134.72	79.61
600016	民生银行	10.88	48.43	110.47	63.81
600837	海通证券	24.06	66.39	234.19	51.52
600036	招商银行	16.59	36.54	99.28	48.59
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
600030	中信证券	33.90	96.41	276.77	86.86
601668	中国建筑	7.28	74.17	255.64	30.85
600837	海通证券	24.06	66.39	234.19	51.52
600999	招商证券	28.27	55.84	305.25	15.61
601628	中国人寿	34.15	51.11	194.92	11.47
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	14.55	-7.85	87.24	-1.21
600637	百视通	37.88	-6.49	81.91	-1.15
600832	东方明珠	13.84	-5.98	164.69	-0.92
601118	海南橡胶	8.72	-5.12	265.73	-0.37
600703	三安光电	14.22	0.71	104.22	0.09

## 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	74.71	50.53	134.72	5.87
600016	民生银行	10.88	48.43	110.47	4.84
600036	招商银行	16.59	36.54	99.28	4.50
600030	中信证券	33.90	96.41	276.77	4.38
600837	海通证券	24.06	66.39	234.19	3.20
贡献前 5 名样本股					
代码	简称	收盘	涨跌幅%	换手率%	贡献点数
600030	中信证券	33.90	96.41	276.77	175.43
601318	中国平安	74.71	50.53	134.72	159.85
600016	民生银行	10.88	48.43	110.47	128.15
600837	海通证券	24.06	66.39	234.19	104.04
600036	招商银行	16.59	36.54	99.28	97.90
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
600369	西南证券	22.29	111.48	331.35	17.83
601669	中国电建	8.43	99.76	409.49	17.67
600030	中信证券	33.90	96.41	276.77	175.43
600705	中航资本	17.89	91.33	45.74	16.95
601800	中国交建	13.89	83.24	461.22	19.82
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
600765	中航重机	19.05	-18.69	124.02	-2.76
600499	科达洁能	18.46	-14.93	67.22	-2.46
600770	综艺股份	8.66	-13.57	107.71	-1.39
600503	华丽家族	5.68	-10.41	144.53	-0.85
600759	洲际油气	9.90	-9.92	38.86	-1.20

### 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	13.90	27.52	81.05	9.57
000651	格力电器	37.12	22.55	45.66	6.79
000001	平安银行	15.84	27.33	135.61	6.37
000776	广发证券	25.95	44.89	218.17	6.09
000783	长江证券	16.82	70.07	335.14	4.66
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	13.90	27.52	81.05	227.44
000783	长江证券	16.82	70.07	335.14	211.42
000776	广发证券	25.95	44.89	218.17	207.79
000562	宏源证券	30.50	73.69	79.39	194.00
000001	平安银行	15.84	27.33	135.61	150.55
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	30.50	73.69	79.39	194.00
000783	长江证券	16.82	70.07	335.14	211.42
000402	金融街	12.33	66.62	159.06	90.04
000024	招商地产	26.39	55.42	191.49	91.17
000776	广发证券	25.95	44.89	218.17	207.79
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
002230	科大讯飞	26.65	-13.33	87.86	-21.83
002594	比亚迪	38.15	-11.89	72.24	-17.45
002236	大华股份	21.95	-9.45	97.86	-11.01
002241	歌尔声学	24.53	-8.23	62.49	-13.73
002353	杰瑞股份	30.57	-7.98	92.74	-9.04

#### 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	13.90	27.52	81.05	6.10
000651	格力电器	37.12	22.55	45.66	4.33
000001	平安银行	15.84	27.33	135.61	4.06
000776	广发证券	25.95	44.89	218.17	3.88
000783	长江证券	16.82	70.07	335.14	2.97
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	13.90	27.52	81.05	47.07
000783	长江证券	16.82	70.07	335.14	43.76
000776	广发证券	25.95	44.89	218.17	43.01
000562	宏源证券	30.50	73.69	79.39	40.15
000001	平安银行	15.84	27.33	135.61	31.16
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	30.50	73.69	79.39	40.15
000783	长江证券	16.82	70.07	335.14	43.76
000402	金融街	12.33	66.62	159.06	18.64
000024	招商地产	26.39	55.42	191.49	18.87
000425	徐工机械	14.97	46.62	224.69	9.67
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
002069	獐子岛	11.90	-23.03	182.35	-1.72
002405	四维图新	19.53	-17.25	90.50	-3.67
002073	软控股份	12.11	-16.88	114.60	-2.80
002456	欧菲光	18.96	-15.70	79.37	-3.98
002230	科大讯飞	26.65	-13.33	87.86	-4.52

## 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	9.00	8.04	140.98	4.66
002415	海康威视	22.37	15.73	50.88	3.42
002202	金风科技	14.13	17.07	98.80	2.82
002304	洋河股份	79.05	31.23	52.90	2.66
002450	康得新	28.97	-12.29	44.99	2.62
贡献前 5 名样本股					
代码	简称	收盘	涨跌幅%	换手率%	贡献点数
002673	西部证券	37.45	78.84	419.27	46.43
002304	洋河股份	79.05	31.23	52.90	34.54
002415	海康威视	22.37	15.73	50.88	25.42
002202	金风科技	14.13	17.07	98.80	22.49
002500	山西证券	16.00	29.24	408.36	20.97
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
002673	西部证券	37.45	78.84	419.27	46.43
002304	洋河股份	79.05	31.23	52.90	34.54
002500	山西证券	16.00	29.24	408.36	20.97
002146	荣盛发展	15.87	26.15	225.91	13.33
002573	国电清新	27.68	20.93	157.94	8.19
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
002190	成飞集成	32.00	-41.06	210.96	-27.11
002229	鸿博股份	15.36	-24.30	135.55	-5.62
002069	獐子岛	11.90	-23.03	182.35	-6.51
002148	北纬通信	18.19	-21.26	113.30	-5.84
002049	同方国芯	24.00	-17.50	71.96	-8.00

## 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	9.00	8.04	140.98	2.61
002415	海康威视	22.37	15.73	50.88	1.91
002202	金风科技	14.13	17.07	98.80	1.58
002304	洋河股份	79.05	31.23	52.90	1.49
002450	康得新	28.97	-12.29	44.99	1.47
贡献前 5 名样本股					
代码	简称	收盘	涨跌幅%	换手率%	贡献点数
002673	西部证券	37.45	78.84	419.27	5.26
002304	洋河股份	79.05	31.23	52.90	3.92
002501	利源精制	27.92	62.70	275.02	3.03
002415	海康威视	22.37	15.73	50.88	2.88
002202	金风科技	14.13	17.07	98.80	2.55
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
002673	西部证券	37.45	78.84	419.27	5.26
002501	利源精制	27.92	62.70	275.02	3.03
002544	杰赛科技	27.84	45.38	132.84	1.67
002304	洋河股份	79.05	31.23	52.90	3.92
002500	山西证券	16.00	29.24	408.36	2.38
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
002190	成飞集成	32.00	-41.06	210.96	-3.07
002401	中海科技	14.58	-28.25	118.59	-0.61
002031	巨轮股份	12.78	-27.39	166.64	-0.98
002382	蓝帆医疗	17.07	-26.64	39.37	-0.43
002253	川大智胜	23.20	-26.37	93.74	-0.69

## 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%
300059	东方财富	27.96	6.68	164.20	4.49
300027	华谊兄弟	26.37	-1.42	163.51	4.18
300070	碧水源	34.80	11.68	86.04	3.88
300024	机器人	39.39	0.90	138.45	3.84
300168	万达信息	46.20	22.61	56.42	2.98
贡献前 5 名样本股					
代码	简称	收盘	涨跌幅%	换手率%	贡献点数
300168	万达信息	46.20	22.61	56.42	8.09
300070	碧水源	34.80	11.68	86.04	5.98
300251	光线传媒	23.64	24.22	302.28	4.14
300059	东方财富	27.96	6.68	164.20	4.13
300144	宋城演艺	30.12	18.12	37.51	2.76
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
300251	光线传媒	23.64	24.22	302.28	4.14
300168	万达信息	46.20	22.61	56.42	8.09
300056	三维丝	21.98	22.31	267.35	1.15
300144	宋城演艺	30.12	18.12	37.51	2.76
300055	万邦达	44.61	15.87	91.91	1.90
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
300037	新宙邦	29.13	-32.15	86.25	-3.13
300096	易联众	9.79	-31.06	119.85	-3.62
300122	智飞生物	19.92	-28.63	85.35	-4.52
300205	天喻信息	13.53	-27.57	128.93	-3.34
300238	冠昊生物	46.77	-26.92	76.13	-3.96

## 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	74.71	50.53	134.72	4.25
600016	民生银行	10.88	48.43	110.47	3.50
600036	招商银行	16.59	36.54	99.28	3.25
600030	中信证券	33.90	96.41	276.77	3.17
600837	海通证券	24.06	66.39	234.19	2.31
贡献前 5 名样本股					
代码	简称	收盘	涨跌幅%	换手率%	贡献点数
600030	中信证券	33.90	96.41	276.77	55.80
601318	中国平安	74.71	50.53	134.72	50.86
600016	民生银行	10.88	48.43	110.47	40.81
600837	海通证券	24.06	66.39	234.19	33.21
600036	招商银行	16.59	36.54	99.28	31.14
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
600369	西南证券	22.29	111.48	331.35	5.67
601669	中国电建	8.43	99.76	409.49	5.60
600030	中信证券	33.90	96.41	276.77	55.80
600705	中航资本	17.89	91.33	45.74	5.33
601800	中国交建	13.89	83.24	461.22	6.33
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
600867	通化东宝	15.60	-23.72	117.30	-1.51
002416	爱施德	10.86	-22.87	101.77	-0.28
000536	华映科技	15.79	-16.94	119.01	-0.43
002456	欧菲光	18.96	-15.70	79.37	-0.92
002230	科大讯飞	26.65	-13.33	87.86	-0.98

## 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%
601099	太平洋	14.22	49.68	360.21	1.26
600169	太原重工	8.72	32.52	266.64	0.53
600266	北京城建	23.66	68.88	317.89	0.53
600694	大商股份	47.93	40.60	113.52	0.51
600881	亚泰集团	7.47	8.89	133.02	0.51
贡献前 5 名样本股					
代码	简称	收盘	涨跌幅%	换手率%	贡献点数
601099	太平洋	14.22	49.68	360.21	21.17
600266	北京城建	23.66	68.88	317.89	12.05
600528	中铁二局	15.05	84.66	502.22	9.78
600694	大商股份	47.93	40.60	113.52	8.19
600169	太原重工	8.72	32.52	266.64	7.04
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
600528	中铁二局	15.05	84.66	502.22	9.78
600266	北京城建	23.66	68.88	317.89	12.05
600657	信达地产	8.16	59.06	217.63	3.73
000680	山推股份	7.55	58.95	255.43	5.51
000528	柳工	12.58	51.75	217.60	6.58
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
000809	铁岭新城	10.26	-33.46	129.94	-3.83
600112	天成控股	11.22	-30.27	99.34	-3.91
000887	中鼎股份	13.80	-27.60	118.39	-5.71
000510	金路集团	5.48	-26.84	126.77	-2.32
600078	澄星股份	6.83	-26.00	156.73	-1.90

## 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	74.71	50.53	134.72	2.30
600030	中信证券	33.90	96.41	276.77	1.86
600016	民生银行	10.88	48.43	110.47	1.73
600036	招商银行	16.59	36.54	99.28	1.34
601166	兴业银行	16.50	35.92	139.10	1.19
贡献前 5 名样本股					
代码	简称	收盘	涨跌幅%	换手率%	贡献点数
600030	中信证券	33.90	96.41	276.77	28.41
601318	中国平安	74.71	50.53	134.72	23.96
600016	民生银行	10.88	48.43	110.47	20.92
600837	海通证券	24.06	66.39	234.19	12.87
600036	招商银行	16.59	36.54	99.28	11.60
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
000987	广州友谊	20.25	117.04	186.03	0.43
600227	赤天化	6.08	114.09	29.05	0.51
600369	西南证券	22.29	111.48	331.35	1.77
601669	中国电建	8.43	99.76	409.49	2.74
600030	中信证券	33.90	96.41	276.77	28.41
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
002190	成飞集成	32.00	-41.06	210.96	-0.81
300254	仟源医药	25.54	-40.60	146.90	-0.26
000622	恒立实业	5.71	-38.20	142.73	-0.18
002613	北玻股份	7.95	-37.70	213.04	-0.18
300367	东方网力	77.80	-35.68	96.52	-0.29

## 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。