

# 广发基金指数月报

(2015年1月5日-2015年1月30日)

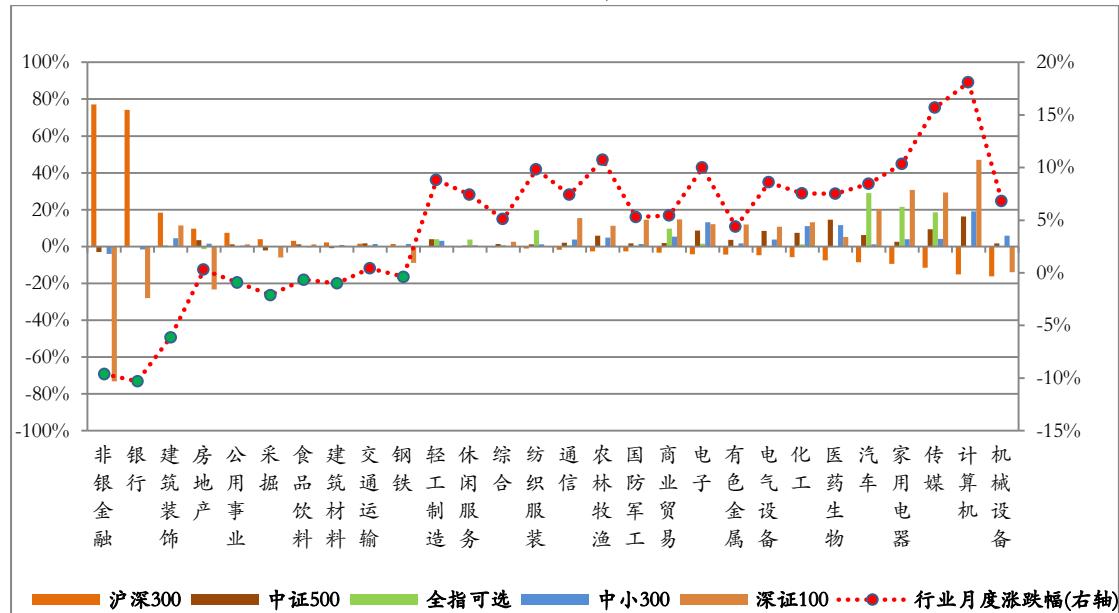
广发基金数量投资部

## 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

本月市场表现依然分化严重，申万28个一级行业涨跌互现，其中计算机行业上涨18.08%，涨幅居首。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77.16%；计算机行业上涨对中证500指数贡献最大，贡献率为16.24%；汽车行业对全指可选指数的贡献最大，贡献率为29.06%；计算机对中小300指数贡献居首，贡献率为19.06%；计算机行业对深证100指数贡献最大，贡献率为47.1%。

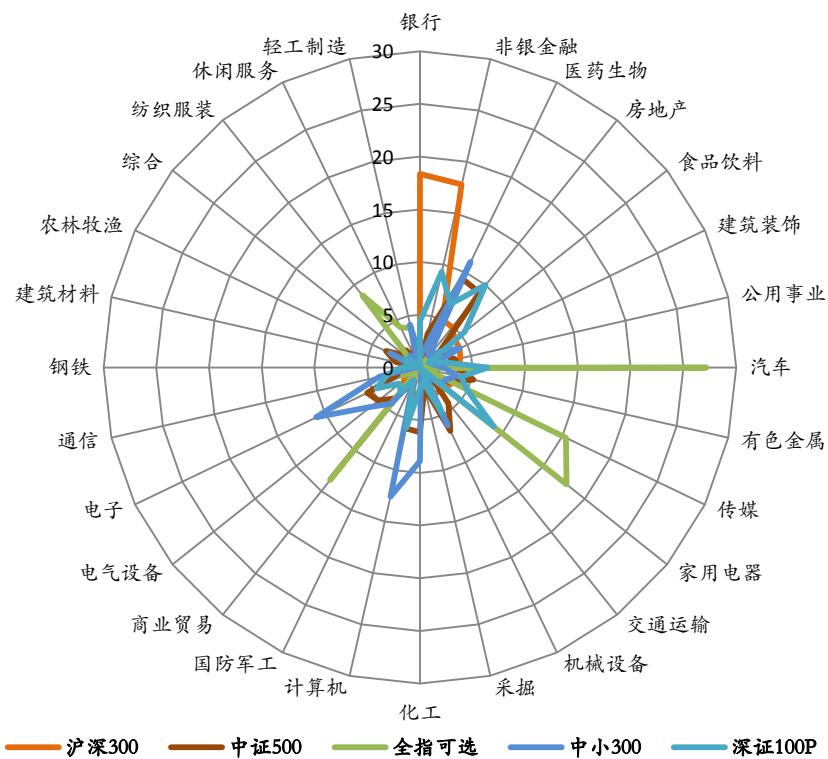
图1 成份行业贡献率与月度涨跌幅



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指数中所占比重居首，为18.37%。医药生物、房地产和机械设备行业在中证500指数中权重居前，依次为9.31%、9.06%和6.70%。汽车、家用电器、传媒在全指可选指数中权重较大，分别为27.2%、17.8%、15.4%。计算机、医药生物、电子在中小

300 指数中权重居前，分别为 12.6%、11.1% 和 10.9%。房地产、非银金融、家用电器在深证 100 指数中权重位列前三，依次为 10.02%、9.31% 和 8.93%。

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 0.61%。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 1.1% 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 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	1.2242	1.2242	1.1573	1.1573	0.3802	2009/11/26
广发沪深 300	1.52	1.81	1.565	1.855	1.0419	2008/12/30
广发中小板 300ETF	1.2151	1.104	1.1021	1.0013	0.6115	2011/6/3
广发中小板 300 联接	1.0875	1.0875	0.9925	0.9925	0.5946	2011/6/9
广发深证 100 分级	1.0496	1.1375	1.0557	1.1111	3.3459	2012/5/7

广发中证 500ETF	1.5836	1.5836	1.4936	1.4936	0.4615	2013/4/11
广发全指可选消费 ETF	1.3565	1.3565	1.2551	1.2551	1.0691	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

1月沪深两市涨跌不一，覆盖两市的申万 A 指上涨 2.17%。指数方面，本期核心市场指数中，创业板指涨幅居首，上涨 14.19%；上证 50 表现最差，下跌 6.82%。

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	2581.57	2612.85	2692.61	2355.26	2405.38	-6.82%	32144.21
上证 180	8044.51	8122.19	8354.59	7451.09	7667.46	-4.69%	52526.36
深证成指	11014.62	11150.98	11749.14	10634.62	11150.69	1.24%	9460.63
深证 100P	3575.30	3607.32	3828.00	3470.81	3665.90	2.53%	15922.62
中小板指	5461.19	5476.31	6260.99	5447.90	6046.61	10.72%	6906.91
中小板 300	1107.18	1109.33	1251.97	1100.27	1218.59	10.06%	11798.92
创业板指	1471.76	1470.58	1759.00	1429.08	1680.58	14.19%	4639.29
沪深 300	3533.71	3566.09	3689.75	3325.68	3434.39	-2.81%	70039.40
中证 500	5322.71	5338.75	5798.57	5222.04	5632.73	5.82%	22737.10
申万 A 指	3094.69	3112.07	3279.30	2993.64	3161.86	2.17%	127096.26

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	2343.53	2355.75	2588.62	2250.30	2321.22	-0.95%	4310.93
全指材料	2803.18	2811.22	3011.02	2690.69	2927.51	4.44%	12845.09
全指工业	3673.62	3695.18	3938.98	3528.93	3778.92	2.87%	26826.57
全指可选	4537.22	4555.87	5091.62	4555.87	4931.07	8.68%	11540.44
全指消费	6656.00	6667.84	6986.20	6436.29	6807.24	2.27%	5012.13
全指医药	7445.90	7448.39	8300.02	7358.52	8044.29	8.04%	4516.85
全指金融	6162.51	6236.61	6335.80	5403.95	5606.72	-9.02%	34995.70
全指信息	4388.26	4395.43	5277.24	4303.36	5064.40	15.41%	11599.06
全指电信	4324.66	4342.24	4805.81	4245.77	4660.57	7.77%	1968.70
全指公用	2791.31	2798.83	2901.21	2517.67	2708.67	-2.96%	4027.35
中证全指	<b>4219.00</b>	<b>4243.09</b>	<b>4451.14</b>	<b>4064.53</b>	<b>4287.84</b>	<b>1.63%</b>	<b>124176.08</b>

图3 核心指数月度表现

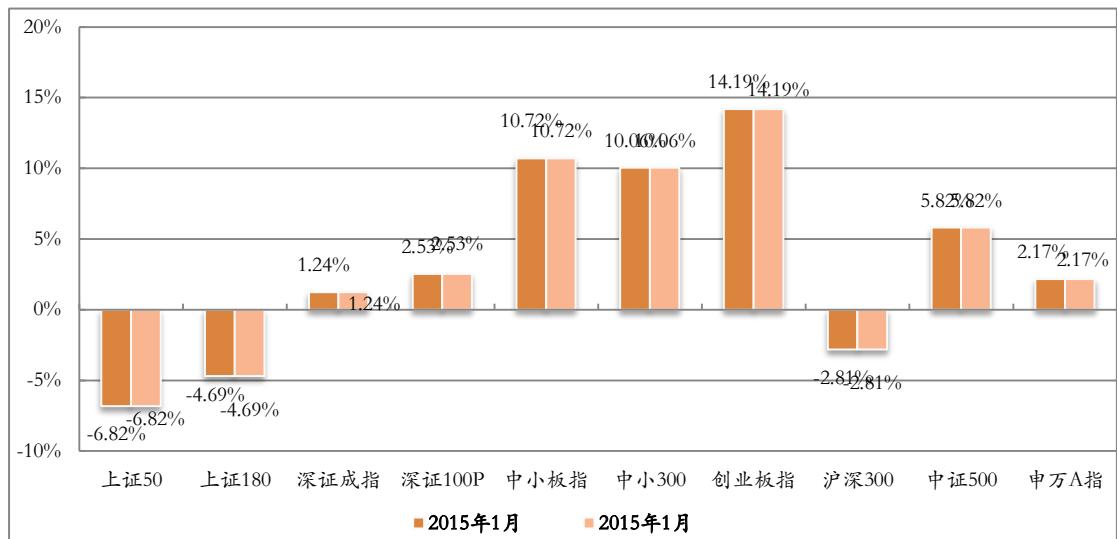


图4 核心指数本月绝对收益

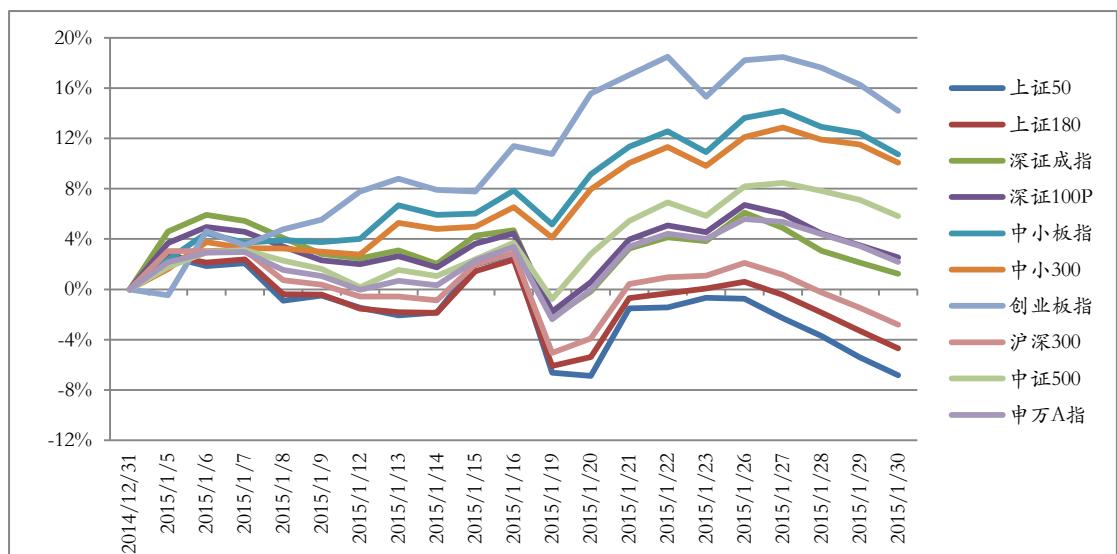
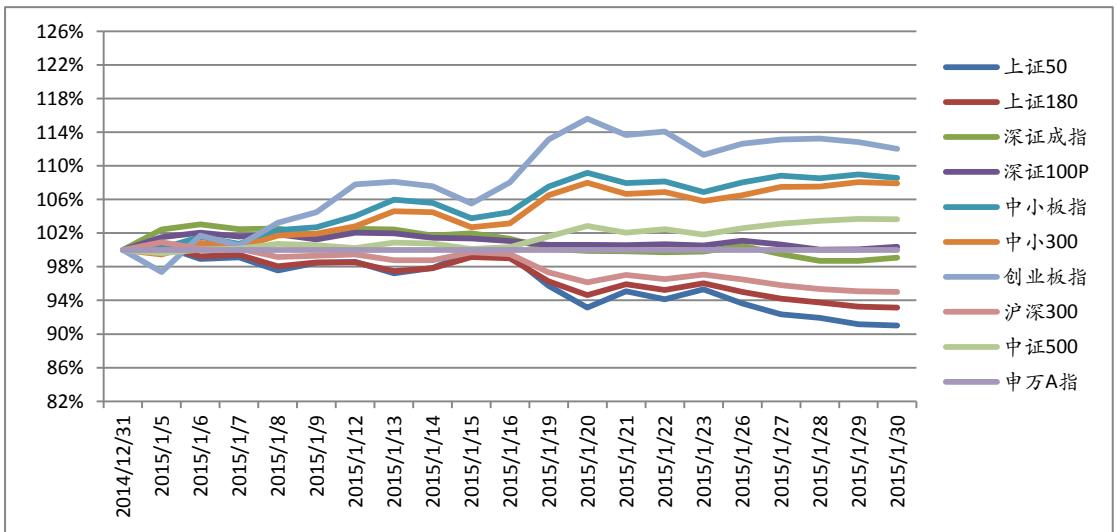


图5 核心指数本月超额收益对比



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

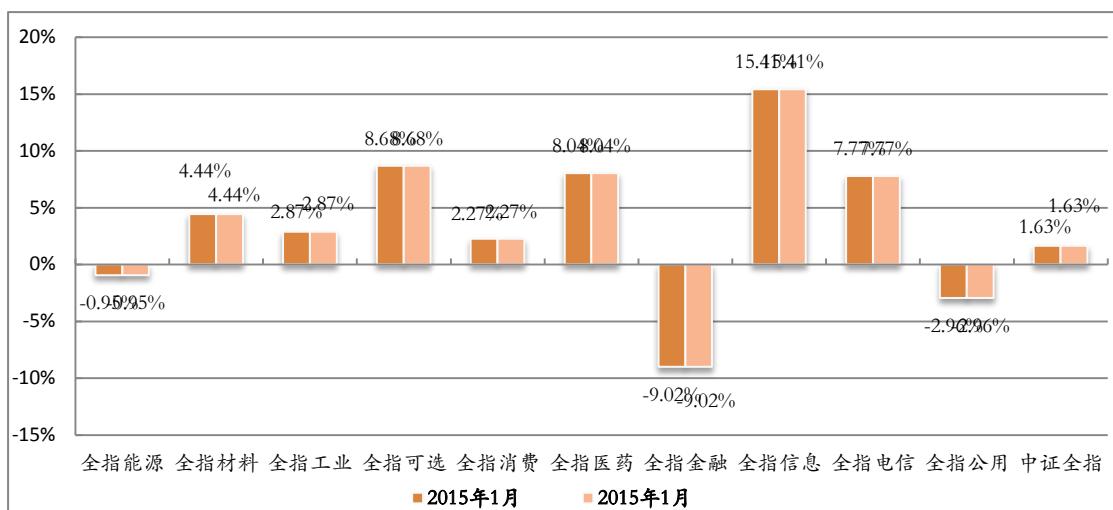


图 7 行业指数本月绝对收益

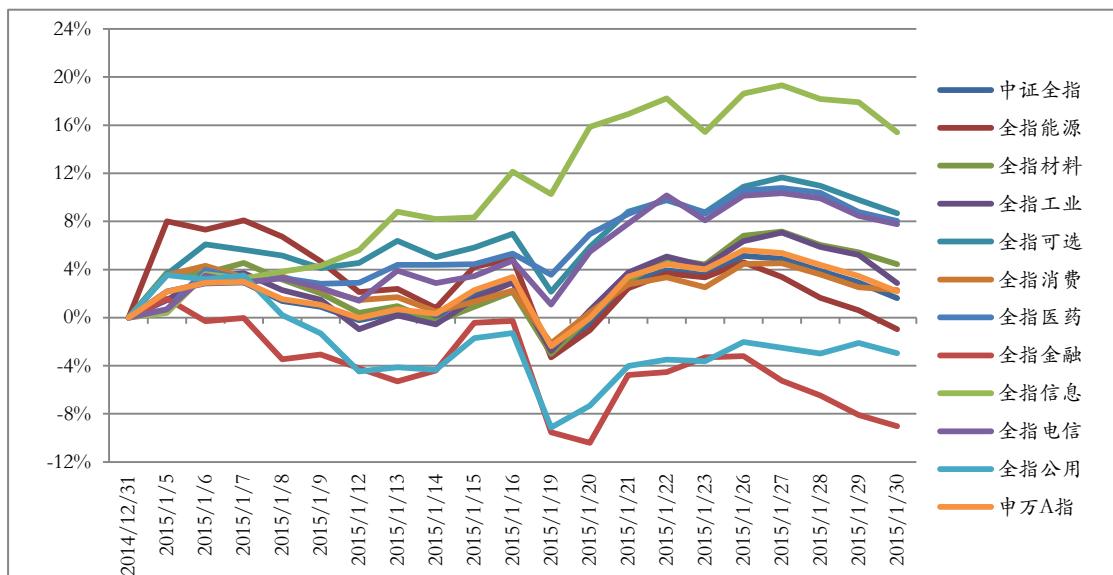
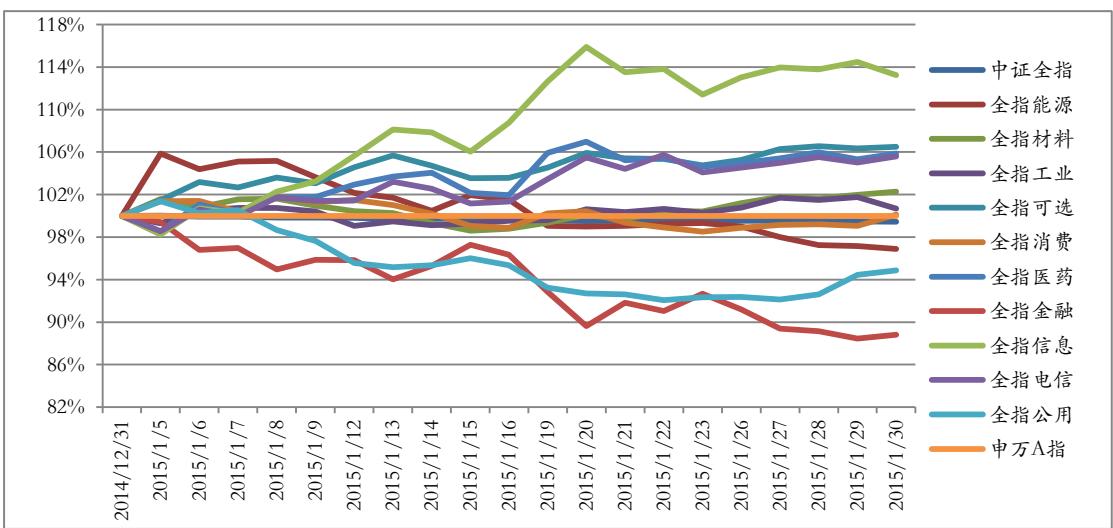


图 8 行业指数本月超额收益对比



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

2015 年 1 月份核心指数的估值水平较上月小幅上升，市场平均动态（2014 年）市盈率为 15.05 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 10.22 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	11.33	10.45	10.22	1.61
上证 180	12.03	11.07	10.73	1.68
深证成指	21.91	18.62	16.97	2.80
深证 100P	25.94	22.34	20.36	2.91
中小板指数	39.21	32.53	29.21	4.24
中小板 300	42.34	36.88	32.28	4.04
创业板指 P	71.52	61.07	49.99	6.70
沪深 300	13.60	12.47	12.04	1.82
中证 500	36.77	33.54	29.74	3.02
申万 A 指	18.01	16.28	15.05	2.18

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	14.61	15.08	15.58	1.61
全指材料	38.15	32.86	29.53	2.29
全指工业	29.66	27.46	24.59	2.66
全指可选	26.50	22.24	18.94	2.99
全指消费	25.48	25.57	23.69	3.59
全指医药	45.07	40.23	36.58	4.77
全指金融	10.21	9.29	8.89	1.53
全指信息	70.92	59.02	48.86	5.05
全指电信	61.80	48.65	36.98	3.25
全指公用	18.95	16.51	15.23	2.17
中证全指	<b>17.82</b>	<b>16.12</b>	<b>14.84</b>	<b>2.15</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	69.29	-7.25	95.00	9.78
600016	民生银行	9.47	-12.36	55.35	7.01
600036	招商银行	14.34	-13.56	53.86	6.46
600030	中信证券	27.86	-17.82	163.70	5.99
601166	兴业银行	14.47	-12.30	69.62	4.52
贡献前 5 名样本股					
代码	简称	收盘	涨跌幅%	换手率%	贡献点数
601766	中国南车	12.56	96.87	252.61	19.16
601299	中国北车	12.89	81.55	199.36	15.40
600010	包钢股份	5.00	22.55	118.99	4.83
600703	三安光电	17.00	19.55	154.55	2.19
600332	白云山	29.95	10.48	92.59	0.99
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
601766	中国南车	12.56	96.87	252.61	19.16
601299	中国北车	12.89	81.55	199.36	15.40
600010	包钢股份	5.00	22.55	118.99	4.83
600703	三安光电	17.00	19.55	154.55	2.19
600332	白云山	29.95	10.48	92.59	0.99
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
601668	中国建筑	5.88	-19.23	117.88	-13.80
600030	中信证券	27.86	-17.82	163.70	-31.19
600837	海通证券	19.87	-17.41	125.35	-22.29
600999	招商证券	23.46	-17.01	128.94	-7.31
600109	国金证券	16.56	-16.32	126.53	-4.21

## 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	69.29	-7.25	95.00	6.14
600016	民生银行	9.47	-12.36	55.35	4.40
600036	招商银行	14.34	-13.56	53.86	4.05
600030	中信证券	27.86	-17.82	163.70	3.76
601166	兴业银行	14.47	-12.30	69.62	2.83
贡献前 5 名样本股					
代码	简称	收盘	涨跌幅%	换手率%	贡献点数
601766	中国南车	12.56	96.87	252.61	38.30
601299	中国北车	12.89	81.55	199.36	30.89
600010	包钢股份	5.00	22.55	118.99	9.71
600588	用友网络	34.04	44.91	165.96	8.08
600804	鹏博士	23.36	29.92	74.70	7.88
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
601766	中国南车	12.56	96.87	252.61	38.30
601299	中国北车	12.89	81.55	199.36	30.89
600588	用友网络	34.04	44.91	165.96	8.08
600240	华业地产	9.47	31.71	33.90	2.52
600804	鹏博士	23.36	29.92	74.70	7.88
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
600369	西南证券	17.47	-21.62	162.41	-7.19
601555	东吴证券	17.60	-21.50	148.87	-8.59
600266	北京城建	19.05	-19.48	154.57	-3.77
601668	中国建筑	5.88	-19.23	117.88	-27.60
600031	三一重工	8.14	-18.44	93.97	-7.36

### 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	13.12	-5.61	69.07	8.76
000651	格力电器	40.40	8.84	36.45	7.27
000001	平安银行	13.93	-12.06	62.54	5.75
000776	广发证券	21.90	-15.61	105.38	4.99
000333	美的集团	30.03	9.44	43.49	4.83
贡献前 5 名样本股					
代码	简称	收盘	涨跌幅%	换手率%	贡献点数
000651	格力电器	40.40	8.84	36.45	65.83
002024	苏宁云商	10.70	18.89	119.28	60.40
000768	中航飞机	24.60	29.88	174.44	55.82
300104	乐视网	48.40	49.20	151.00	50.24
000625	长安汽车	19.18	16.74	43.93	49.40
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
300104	乐视网	48.40	49.20	151.00	50.24
002081	金螳螂	22.73	35.30	55.61	43.97
000768	中航飞机	24.60	29.88	174.44	55.82
000792	盐湖股份	26.88	23.87	81.05	27.70
002230	科大讯飞	32.00	20.07	113.31	25.49
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
000783	长江证券	13.32	-20.81	118.79	-106.07
000402	金融街	10.16	-17.60	82.86	-33.52
000776	广发证券	21.90	-15.61	105.38	-102.81
000157	中联重科	6.12	-13.31	75.37	-34.03
000001	平安银行	13.93	-12.06	62.54	-87.86

#### 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	13.12	-5.61	69.07	5.42
000651	格力电器	40.40	8.84	36.45	4.50
000001	平安银行	13.93	-12.06	62.54	3.56
000776	广发证券	21.90	-15.61	105.38	3.09
000333	美的集团	30.03	9.44	43.49	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
000651	格力电器	40.40	8.84	36.45	13.43
002024	苏宁云商	10.70	18.89	119.28	12.30
000768	中航飞机	24.60	29.88	174.44	11.37
300104	乐视网	48.40	49.20	151.00	10.24
000625	长安汽车	19.18	16.74	43.93	10.07
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
300104	乐视网	48.40	49.20	151.00	10.24
002081	金螳螂	22.73	35.30	55.61	8.96
002065	东华软件	24.18	35.01	157.24	8.61
002385	大北农	17.98	33.98	72.03	6.38
300017	网宿科技	62.99	30.68	135.49	5.31
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
000783	长江证券	13.32	-20.81	118.79	-21.61
000425	徐工机械	11.87	-20.71	105.00	-6.67
000402	金融街	10.16	-17.60	82.86	-6.83
000686	东北证券	16.51	-17.37	142.44	-6.99
002500	山西证券	13.50	-15.63	157.71	-4.41

## 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	10.70	18.89	119.28	4.71
002415	海康威视	26.66	19.18	44.32	3.80
002450	康得新	32.46	12.05	44.26	2.69
002202	金风科技	14.67	3.82	71.81	2.48
002241	歌尔声学	28.70	17.00	84.97	2.25
贡献前 5 名样本股					
代码	简称	收盘	涨跌幅%	换手率%	贡献点数
002024	苏宁云商	10.70	18.89	119.28	45.21
002415	海康威视	26.66	19.18	44.32	36.98
002081	金螳螂	22.73	35.30	55.61	32.92
002065	东华软件	24.18	35.01	157.24	31.64
002385	大北农	17.98	33.98	72.03	23.43
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
002081	金螳螂	22.73	35.30	55.61	32.92
002065	东华软件	24.18	35.01	157.24	31.64
002385	大北农	17.98	33.98	72.03	23.43
002410	广联达	29.90	33.48	73.65	22.03
002653	海思科	22.61	31.91	86.27	6.78
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
002673	西部证券	29.00	-22.56	237.78	-23.07
002500	山西证券	13.50	-15.63	157.71	-16.22
002168	深圳惠程	8.86	-12.54	42.40	-3.50
002142	宁波银行	13.89	-11.70	104.99	-14.89
002051	中工国际	26.10	-4.47	76.02	-2.57

## 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	10.70	18.89	119.28	2.66
002415	海康威视	26.66	19.18	44.32	2.15
002450	康得新	32.46	12.05	44.26	1.52
002202	金风科技	14.67	3.82	71.81	1.40
002241	歌尔声学	28.70	17.00	84.97	1.27
贡献前 5 名样本股					
代码	简称	收盘	涨跌幅%	换手率%	贡献点数
002024	苏宁云商	10.70	18.89	119.28	5.15
002415	海康威视	26.66	19.18	44.32	4.22
002081	金螳螂	22.73	35.30	55.61	3.75
002065	东华软件	24.18	35.01	157.24	3.61
002385	大北农	17.98	33.98	72.03	2.67
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
002095	生意宝	50.17	58.87	298.63	1.20
002681	奋达科技	40.30	47.03	209.63	0.76
002285	世联行	21.00	39.63	77.02	1.51
002318	久立特材	41.18	37.82	112.11	1.48
002081	金螳螂	22.73	35.30	55.61	3.75
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
002240	威华股份	16.91	-24.48	138.04	-1.19
002673	西部证券	29.00	-22.56	237.78	-2.63
002500	山西证券	13.50	-15.63	157.71	-1.85
002501	利源精制	24.20	-13.32	181.23	-0.99
002168	深圳惠程	8.86	-12.54	42.40	-0.40

## 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	38.51	37.73	121.26	5.06
300027	华谊兄弟	27.69	5.01	109.97	3.72
300070	碧水源	35.02	0.63	46.98	3.25
300024	机器人	40.57	3.00	79.09	3.24
300104	乐视网	48.40	49.20	151.00	2.88
贡献前 5 名样本股					
代码	简称	收盘	涨跌幅%	换手率%	贡献点数
300059	东方财富	38.51	37.73	121.26	23.32
300104	乐视网	48.40	49.20	151.00	15.99
300226	上海钢联	93.48	54.85	96.64	8.53
300017	网宿科技	62.99	30.68	135.49	8.30
300253	卫宁软件	92.00	31.48	108.87	8.29
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
300226	上海钢联	93.48	54.85	96.64	8.53
300104	乐视网	48.40	49.20	151.00	15.99
300295	三六五网	110.30	45.51	128.89	3.85
300059	东方财富	38.51	37.73	121.26	23.32
300096	易联众	13.16	34.42	224.81	2.97
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
300071	华谊嘉信	15.08	-8.05	8.96	-0.60
300202	聚龙股份	29.05	-5.96	22.13	-1.18
300288	朗玛信息	175.61	-5.59	39.34	-0.82
300267	尔康制药	39.14	-0.86	30.51	-0.17
300183	东软载波	52.26	-0.82	93.47	-0.11

## 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	69.29	-7.25	95.00	4.35
600016	民生银行	9.47	-12.36	55.35	3.12
600036	招商银行	14.34	-13.56	53.86	2.87
600030	中信证券	27.86	-17.82	163.70	2.66
601166	兴业银行	14.47	-12.30	69.62	2.01
贡献前 5 名样本股					
代码	简称	收盘	涨跌幅%	换手率%	贡献点数
601766	中国南车	12.56	96.87	252.61	12.19
601299	中国北车	12.89	81.55	199.36	9.80
000651	格力电器	40.40	8.84	36.45	3.31
002024	苏宁云商	10.70	18.89	119.28	3.17
000768	中航飞机	24.60	29.88	174.44	3.16
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
601766	中国南车	12.56	96.87	252.61	12.19
601299	中国北车	12.89	81.55	199.36	9.80
600588	用友网络	34.04	44.91	165.96	2.58
002081	金螳螂	22.73	35.30	55.61	2.24
002065	东华软件	24.18	35.01	157.24	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
002673	西部证券	29.00	-22.56	237.78	-1.70
600369	西南证券	17.47	-21.62	162.41	-2.28
601555	东吴证券	17.60	-21.50	148.87	-2.72
000783	长江证券	13.32	-20.81	118.79	-4.85
000425	徐工机械	11.87	-20.71	105.00	-1.66

## 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%
300059	东方财富	38.51	37.73	121.26	1.11
601099	太平洋	11.68	-17.86	116.44	0.98
300168	万达信息	52.99	14.70	35.37	0.61
600410	华胜天成	26.06	27.93	127.46	0.57
000998	隆平高科	21.46	8.99	93.36	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
300059	东方财富	38.51	37.73	121.26	17.09
601519	大智慧	10.60	77.26	0.93	7.06
600410	华胜天成	26.06	27.93	127.46	6.94
600201	金宇集团	46.15	31.56	31.13	6.07
300253	卫宁软件	92.00	31.48	108.87	5.48
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
601519	大智慧	10.60	77.26	0.93	7.06
600021	上海电力	11.98	53.39	202.32	5.13
603555	贵人鸟	24.07	43.62	217.83	1.72
002285	世联行	21.00	39.63	77.02	4.28
300059	东方财富	38.51	37.73	121.26	17.09
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
002240	威华股份	16.91	-24.48	138.04	-3.10
600428	中远航运	6.42	-19.75	131.09	-2.51
600266	北京城建	19.05	-19.48	154.57	-5.56
000528	柳工	10.29	-18.20	111.08	-3.46
601099	太平洋	11.68	-17.86	116.44	-11.99

## 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	69.29	-7.25	95.00	2.37
600030	中信证券	27.86	-17.82	163.70	1.54
600016	民生银行	9.47	-12.36	55.35	1.35
600036	招商银行	14.34	-13.56	53.86	1.11
600000	浦发银行	14.47	-7.78	74.96	1.03
贡献前 5 名样本股					
代码	简称	收盘	涨跌幅%	换手率%	贡献点数
601766	中国南车	12.56	96.87	252.61	4.86
601299	中国北车	12.89	81.55	199.36	4.14
300059	东方财富	38.51	37.73	121.26	1.81
600010	包钢股份	5.00	22.55	118.99	1.65
000651	格力电器	40.40	8.84	36.45	1.63
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
000627	天茂集团	8.26	101.46	82.73	0.98
601766	中国南车	12.56	96.87	252.61	4.86
000626	如意集团	24.55	88.41	300.66	0.21
600986	科达股份	13.15	86.53	83.84	0.31
601299	中国北车	12.89	81.55	199.36	4.14
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
300160	秀强股份	11.80	-27.83	166.14	-0.08
002207	准油股份	13.09	-26.46	140.13	-0.18
002240	威华股份	16.91	-24.48	138.04	-0.35
002673	西部证券	29.00	-22.56	237.78	-0.75
600369	西南证券	17.47	-21.62	162.41	-0.86

## 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:

$$\text{静态PE} = \frac{\sum(\text{最新价格}_{\text{个股}} \times \text{最新总股本}_{\text{个股}})}{\sum(\text{最近年报归属母公司利润}_{\text{个股}})}$$

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:

$$\text{一年滚动PE} = \frac{\sum(\text{最新价格}_{\text{个股}} \times \text{最新总股本}_{\text{个股}})}{\sum(\text{最新滚动归属母公司利润}_{\text{个股}})}$$

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:

$$\text{动态PE} = \frac{\sum(\text{最新价格}_{\text{个股}} \times \text{最新总股本}_{\text{个股}})}{\sum(\text{最新滚动归属母公司利润}_{\text{个股}})}$$

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。