

广发基金指数月报

(2015年2月2日—2015年2月27日)

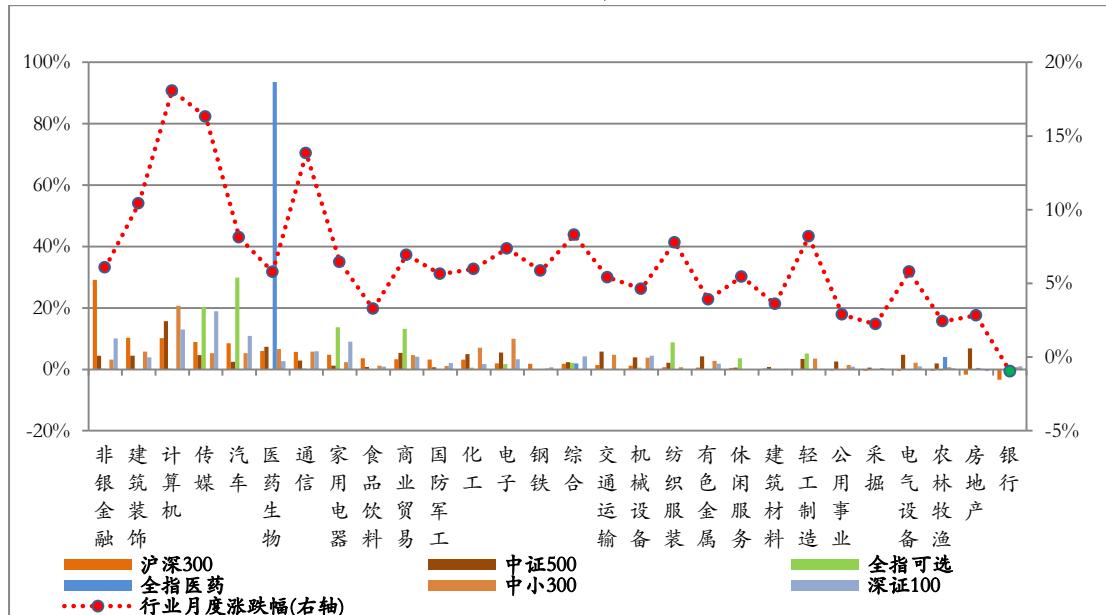
广发基金数量投资部

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

本月市场小幅反弹，申万 28 个一级行业仅银行微跌 0.95%，其余均上涨，计算机行业涨幅达 18.1%。从各指数成份股的行业贡献率来看，非银金融行业对沪深 300 指数影响最大，贡献率为 29.2%；计算机行业对中证 500 指数贡献最大，贡献率为 15.7%；汽车行业对全指可选指数的贡献最大，贡献率为 29.8%；医药生物行业对全指医药贡献率为 93.6%；计算机行业对中小 300 指数贡献居首，贡献率为 20.7%；传媒行业对深证 100 指数贡献最大，贡献率为 18.9%。

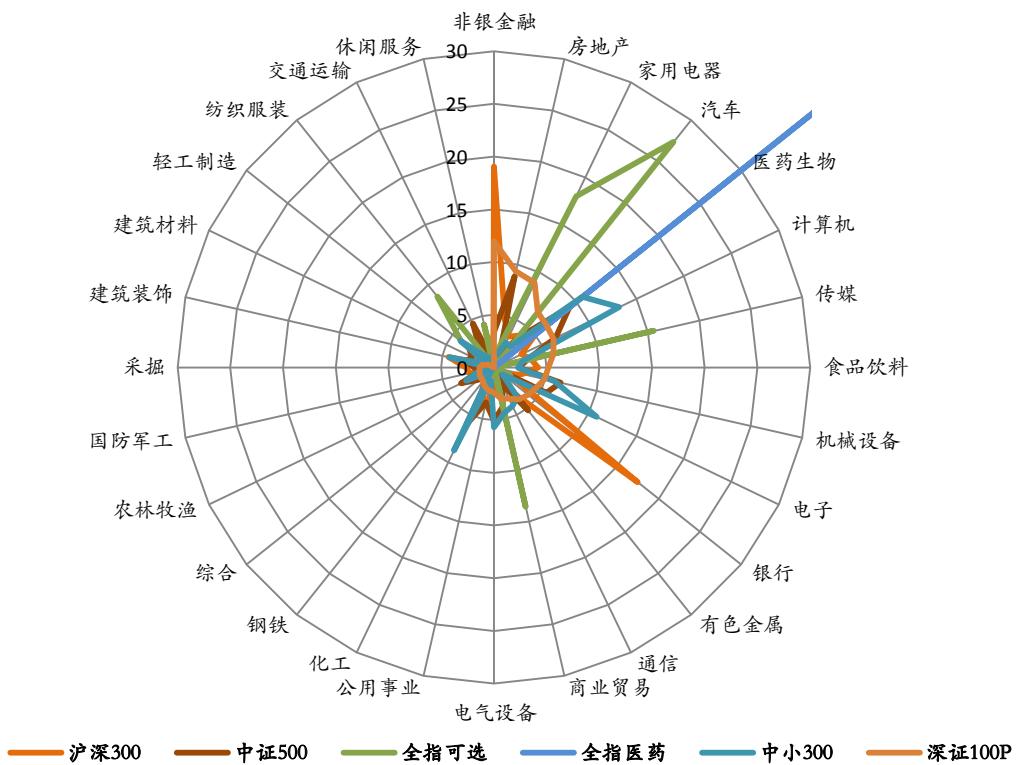
图 1 成份行业贡献率与月度涨跌幅



以巨潮数据库提供的权重数据计算，本月末非银金融行业在沪深 300 指数中所占权重居首，为 19.1%。医药生物、房地产和计算机行业在中证 500 指数中权重居前，依次为 9.17%、8.89% 和 6.53%。汽车、家用电器、传媒在全指可选指数中权重较大，分别为 27.4%、18.0%、15.6%。计算机、电子、医药生物在中小

300 指数中权重居前，分别为 13.2%、10.84% 和 10.75%。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 11.98%、9.36% 和 8.92%。

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 0.51%。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	2015 年 2 月		2015 年 1 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	1.3023	1.3023	1.2242	1.2242	0.1842	2009/11/26
广发沪深 300	1.576	1.866	1.52	1.81	1.0219	2008/12/30
广发中小板 300ETF	1.3213	1.2005	1.2151	1.104	0.5147	2011/6/3
广发中小板 300 联接	1.1768	1.1768	1.0875	1.0875	0.5808	2011/6/9
广发深证 100 分级	1.1095	1.1974	1.0496	1.1375	2.4339	2012/5/7

广发中证 500ETF	1.6894	1.6894	1.5836	1.5836	0.2600	2013/4/11
广发全指可选消费 ETF	1.4611	1.4611	1.3565	1.3565	0.4297	2014/6/3
广发全指医药卫生 ETF	1.1187	1.1187	1.0729	1.0729	0.8943	2014/12/1

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

2月沪深两市上涨，覆盖两市的申万A指上涨67%。指数方面，本期核心市场指数中，创业板指涨幅居首，上涨14.7%；上证50表现最差，涨幅为2.88%。

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	2405.38	2337.20	2498.70	2303.11	2474.60	2.88%	14478.26
上证180	7667.46	7487.16	8002.57	7342.64	7947.05	3.65%	25045.36
深证成指	11150.69	10952.14	11819.42	10715.43	11757.68	5.44%	5421.90
深证100P	3665.90	3607.91	3920.02	3540.27	3900.14	6.39%	9889.27
中小板指	6046.61	5989.66	6652.53	5978.76	6630.63	9.66%	5026.66
中小板300	1218.59	1207.06	1325.26	1202.24	1323.69	8.62%	8679.09
创业板指	1680.58	1667.12	1928.04	1660.05	1928.04	14.72%	3857.01
沪深300	3434.39	3360.19	3594.81	3285.94	3572.84	4.03%	34878.24
中证500	5632.73	5568.44	6025.12	5492.55	6018.46	6.85%	14907.81
申万A指	3161.86	3112.31	3357.66	3070.84	3351.62	6.00%	75408.79

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	2321.22	2302.82	2383.89	2195.55	2356.75	1.53%	1855.96
全指材料	2927.51	2892.53	3072.62	2817.24	3068.11	4.80%	7247.70
全指工业	3778.92	3723.22	4018.65	3606.58	4009.08	6.09%	14658.63
全指可选	4931.07	4878.54	5334.85	4838.12	5326.75	8.02%	8664.29
全指消费	6807.24	6761.49	7112.03	6586.40	7101.12	4.32%	3093.83
全指医药	8044.29	7976.06	8409.64	7828.68	8391.86	4.32%	2756.29
全指金融	5606.72	5433.77	5832.26	5393.75	5763.58	2.80%	16401.31
全指信息	5064.40	5019.75	5820.11	5003.88	5815.02	14.82%	10168.75
全指电信	4660.57	4614.97	5238.87	4559.25	5206.70	11.72%	1736.59
全指公用	2708.67	2653.23	2771.51	2482.91	2760.45	1.91%	2203.27
中证全指	4287.84	4218.59	4549.66	4160.42	4540.14	5.88%	73113.90

图3 核心指数月度表现

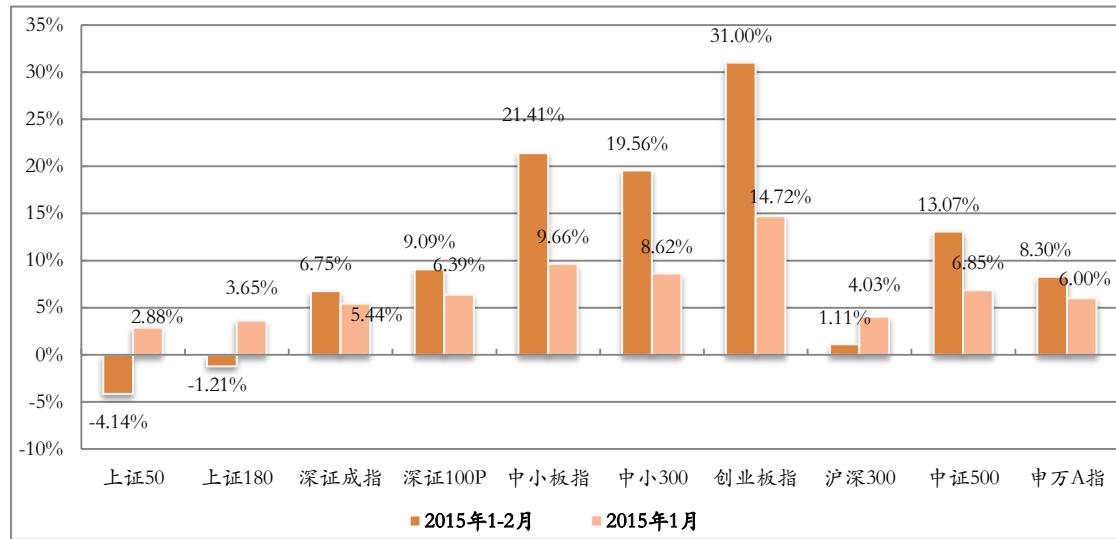


图4 核心指数本月绝对收益

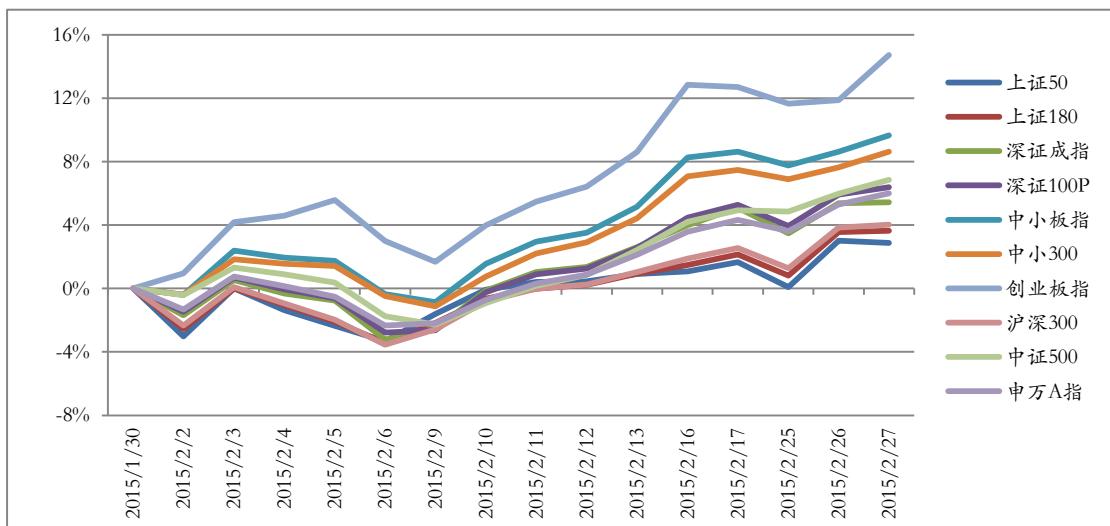
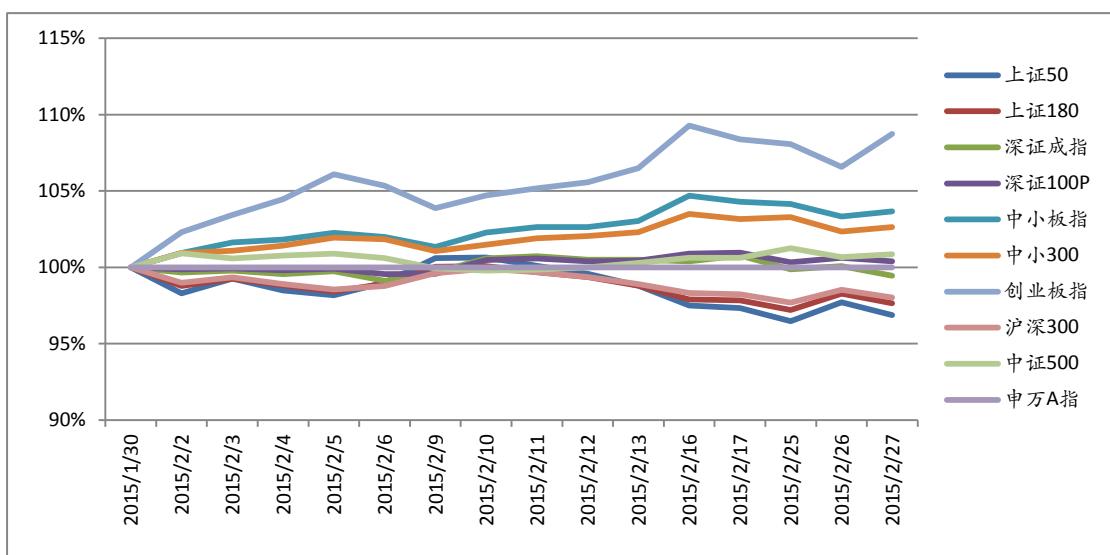


图5 核心指数本月超额收益对比



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

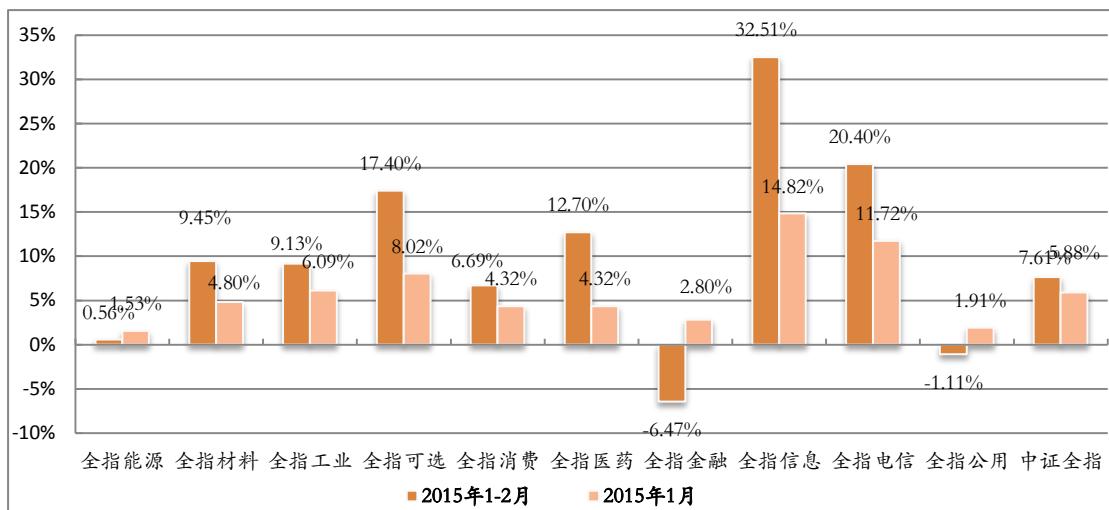


图 7 行业指数本月绝对收益

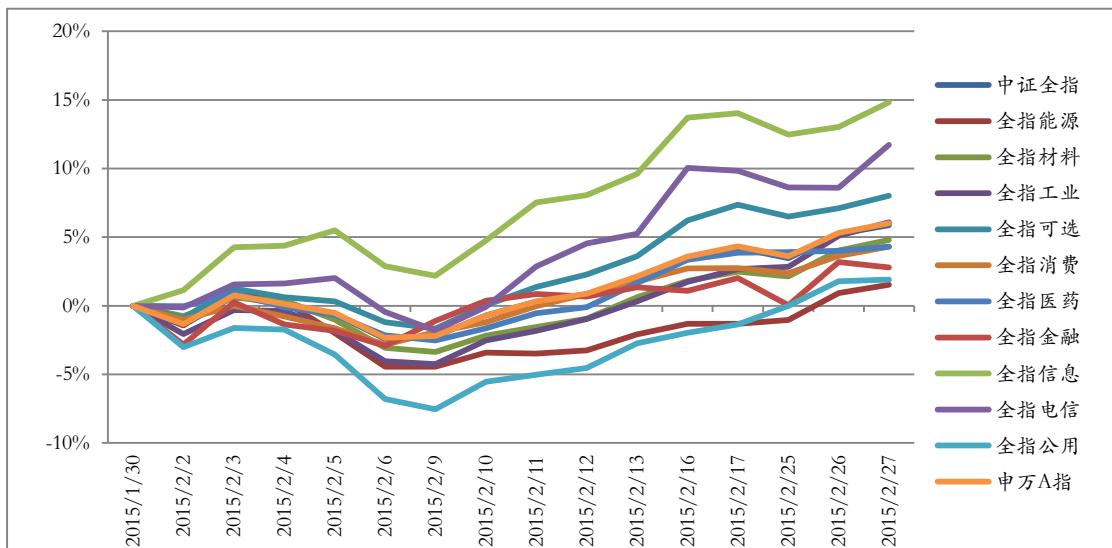
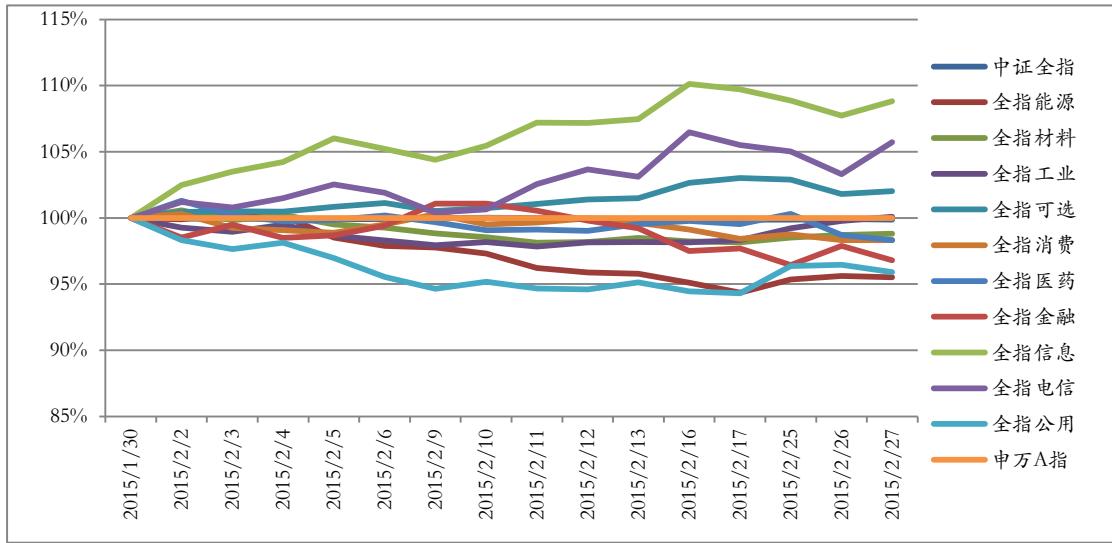


图 8 行业指数本月超额收益对比



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 2 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	11.20	10.41	10.11	1.60
上证 180	11.84	10.95	10.54	1.67
深证成指	22.30	19.37	17.73	2.90
深证 100P	26.77	23.48	21.31	3.04
中小板指数	42.19	34.65	31.88	4.53
中小板 300	45.21	39.52	35.33	4.30
创业板指 P	77.76	67.29	57.72	7.39
沪深 300	13.47	12.43	11.91	1.82
中证 500	37.97	35.64	31.65	3.14
申万 A 指	18.33	16.76	15.20	2.23

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	14.14	14.87	15.12	1.53
全指材料	39.15	34.40	30.12	2.36
全指工业	30.64	28.39	24.96	2.72
全指可选	27.58	23.72	20.20	3.16
全指消费	26.43	26.78	25.11	3.72
全指医药	45.70	41.89	38.13	4.90
全指金融	9.92	9.08	8.61	1.52
全指信息	78.26	66.02	57.04	5.76
全指电信	61.07	54.20	40.68	3.53
全指公用	18.94	16.50	15.09	2.17
中证全指	18.09	16.54	14.96	2.20

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	70.28	1.43	38.84	9.64
600016	民生银行	9.23	-2.53	19.64	6.64
600036	招商银行	14.70	2.51	20.97	6.44
600030	中信证券	29.53	5.99	71.75	6.17
600837	海通证券	21.76	9.51	64.09	4.67
贡献前 5 名样本股					
代码	简称	收盘	涨跌幅%	换手率%	贡献点数
600837	海通证券	21.76	9.51	64.09	10.05
600030	中信证券	29.53	5.99	71.75	8.63
600999	招商证券	27.81	18.54	116.11	6.65
600050	中国联通	5.65	25.00	78.97	6.28
600518	康美药业	22.63	36.08	104.98	6.04
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
600518	康美药业	22.63	36.08	104.98	6.04
600109	国金证券	21.00	26.81	85.43	5.79
600050	中国联通	5.65	25.00	78.97	6.28
600999	招商证券	27.81	18.54	116.11	6.65
601901	方正证券	13.21	9.53	71.66	3.11
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
601118	海南橡胶	8.73	-4.49	56.54	-0.32
601766	中国南车	12.12	-3.50	105.48	-1.36
601288	农业银行	3.34	-3.47	30.35	-2.04
600048	保利地产	10.19	-2.77	47.38	-1.23
601998	中信银行	6.77	-2.59	48.42	-0.35

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	70.28	1.43	38.84	6.00
600016	民生银行	9.23	-2.53	19.64	4.13
600036	招商银行	14.70	2.51	20.97	4.00
600030	中信证券	29.53	5.99	71.75	3.84
600837	海通证券	21.76	9.51	64.09	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
600837	海通证券	21.76	9.51	64.09	20.08
600030	中信证券	29.53	5.99	71.75	17.23
600999	招商证券	27.81	18.54	116.11	13.22
600050	中国联通	5.65	25.00	78.97	12.56
600518	康美药业	22.63	36.08	104.98	12.12
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
600060	海信电器	20.20	42.35	161.07	6.14
601216	内蒙君正	18.12	36.86	235.25	3.92
600998	九州通	24.52	36.30	206.92	2.79
600518	康美药业	22.63	36.08	104.98	12.12
600770	综艺股份	12.68	30.99	126.11	3.06
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
600875	东方电气	19.47	-10.52	113.66	-1.84
600839	四川长虹	5.17	-9.77	61.79	-2.70
600108	亚盛集团	9.31	-9.52	75.69	-2.03
600011	华能国际	7.70	-7.12	34.42	-3.27
600259	广晟有色	55.28	-6.94	67.48	-0.68

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	12.75	-2.82	32.30	8.07
000651	格力电器	40.53	0.32	20.33	6.92
000001	平安银行	13.99	0.43	26.34	5.47
000776	广发证券	23.64	7.95	54.83	5.10
000333	美的集团	31.46	4.76	17.36	4.80
贡献前 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	79.90	65.08	120.62	99.15
000100	TCL 集团	5.02	29.05	81.17	75.20
002594	比亚迪	50.58	32.20	65.56	58.12
002081	金螳螂	28.74	26.44	30.96	44.56
000776	广发证券	23.64	7.95	54.83	44.17
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	79.90	65.08	120.62	99.15
002594	比亚迪	50.58	32.20	65.56	58.12
000100	TCL 集团	5.02	29.05	81.17	75.20
002081	金螳螂	28.74	26.44	30.96	44.56
002230	科大讯飞	39.90	24.69	90.63	37.64
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
000166	申万宏源	15.76	-6.47	94.78	-32.89
000858	五粮液	21.38	-3.69	29.12	-12.68
002353	杰瑞股份	33.95	-3.41	50.98	-4.08
000002	万科 A	12.75	-2.82	32.30	-27.54
000792	盐湖股份	26.42	-1.71	53.29	-2.46

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	12.75	-2.82	32.30	4.95
000651	格力电器	40.53	0.32	20.33	4.24
000001	平安银行	13.99	0.43	26.34	3.35
000776	广发证券	23.64	7.95	54.83	3.13
000333	美的集团	31.46	4.76	17.36	2.94
贡献前 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	79.90	65.08	120.62	20.20
000100	TCL 集团	5.02	29.05	81.17	15.31
002594	比亚迪	50.58	32.20	65.56	11.83
002081	金螳螂	28.74	26.44	30.96	9.07
000776	广发证券	23.64	7.95	54.83	8.99
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
300104	乐视网	79.90	65.08	120.62	20.20
300315	掌趣科技	25.50	61.09	81.55	8.01
002594	比亚迪	50.58	32.20	65.56	11.83
000100	TCL 集团	5.02	29.05	81.17	15.31
300017	网宿科技	81.05	28.67	77.28	6.48
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
000166	申万宏源	15.76	-6.47	94.78	-6.70
000831	五矿稀土	33.77	-6.19	65.61	-2.31
000858	五粮液	21.38	-3.69	29.12	-2.58
002353	杰瑞股份	33.95	-3.41	50.98	-0.83
000826	桑德环境	27.88	-3.03	84.75	-0.76

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	11.68	9.16	94.66	4.68
002415	海康威视	29.58	10.95	24.42	3.84
002450	康得新	35.74	10.10	31.98	2.70
002594	比亚迪	50.58	32.20	65.56	2.69
002081	金螳螂	28.74	26.44	30.96	2.41
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
002183	怡亚通	28.55	57.91	139.97	43.96
002594	比亚迪	50.58	32.20	65.56	43.50
002153	石基信息	97.64	28.58	53.88	15.28
002673	西部证券	37.00	27.59	151.00	21.84
002219	恒康医疗	27.75	26.83	50.52	11.64
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
002437	誉衡药业	27.10	-4.24	68.03	-1.92
002353	杰瑞股份	33.95	-3.41	50.98	-3.05
002041	登海种业	33.93	-2.22	35.33	-0.73
002155	辰州矿业	10.57	-1.77	35.20	-0.86
002007	华兰生物	35.52	-1.55	29.02	-1.12

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	11.68	9.16	94.66	2.67
002415	海康威视	29.58	10.95	24.42	2.19
002450	康得新	35.74	10.10	31.98	1.54
002594	比亚迪	50.58	32.20	65.56	1.54
002081	金螳螂	28.74	26.44	30.96	1.37
贡献前 5 名样本股					
代码	简称	收盘	涨跌幅%	换手率%	贡献点数
002183	怡亚通	28.55	57.91	139.97	5.01
002594	比亚迪	50.58	32.20	65.56	4.96
002081	金螳螂	28.74	26.44	30.96	3.80
002230	科大讯飞	39.90	24.69	90.63	3.21
002024	苏宁云商	11.68	9.16	94.66	2.97
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
002095	生意宝	87.18	73.77	253.04	2.38
002195	海隆软件	79.05	60.93	42.91	1.39
002183	怡亚通	28.55	57.91	139.97	5.01
002197	证通电子	23.68	46.44	195.91	0.93
002642	荣之联	51.71	41.09	17.51	0.54
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	14.81	-12.42	106.84	-0.46
002186	全聚德	20.11	-7.24	31.87	-0.19
002271	东方雨虹	38.75	-5.72	22.32	-0.32
002556	辉隆股份	13.48	-5.14	73.07	-0.16
002009	天奇股份	19.11	-4.45	48.64	-0.17

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	41.25	7.12	36.12	4.73
300104	乐视网	79.90	65.08	120.62	4.15
300027	华谊兄弟	30.59	10.47	72.07	3.59
300168	万达信息	65.98	24.51	23.90	3.06
300024	机器人	43.84	8.06	46.98	3.05
贡献前 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	79.90	65.08	120.62	31.55
300315	掌趣科技	25.50	61.09	81.55	12.53
300168	万达信息	65.98	24.51	23.90	11.61
300017	网宿科技	81.05	28.67	77.28	10.13
300212	易华录	46.15	50.33	103.05	8.13
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
300104	乐视网	79.90	65.08	120.62	31.55
300315	掌趣科技	25.50	61.09	81.55	12.53
300212	易华录	46.15	50.33	103.05	8.13
300011	鼎汉技术	25.75	49.28	64.21	4.86
300216	千山药机	54.75	47.97	70.36	6.08
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
300004	南风股份	44.09	-9.41	15.58	-1.28
300199	翰宇药业	32.13	-5.47	32.67	-1.01
300122	智飞生物	22.39	-0.49	25.91	-0.06
300267	尔康制药	39.07	-0.18	17.49	-0.03
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	70.28	1.43	38.84	4.23
600016	民生银行	9.23	-2.53	19.64	2.91
600036	招商银行	14.70	2.51	20.97	2.83
600030	中信证券	29.53	5.99	71.75	2.71
600837	海通证券	21.76	9.51	64.09	2.05
贡献前 5 名样本股					
代码	简称	收盘	涨跌幅%	换手率%	贡献点数
600837	海通证券	21.76	9.51	64.09	6.37
600030	中信证券	29.53	5.99	71.75	5.48
600999	招商证券	27.81	18.54	116.11	4.22
600050	中国联通	5.65	25.00	78.97	4.02
600518	康美药业	22.63	36.08	104.98	3.84
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
600060	海信电器	20.20	42.35	161.07	1.96
601216	内蒙君正	18.12	36.86	235.25	1.23
600998	九州通	24.52	36.30	206.92	0.90
600518	康美药业	22.63	36.08	104.98	3.84
000156	华数传媒	37.62	34.31	98.07	0.29
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
600875	东方电气	19.47	-10.52	113.66	-0.57
600839	四川长虹	5.17	-9.77	61.79	-0.87
600108	亚盛集团	9.31	-9.52	75.69	-0.64
601727	上海电气	10.11	-7.50	142.18	-0.68
600011	华能国际	7.70	-7.12	34.42	-1.03

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	41.25	7.12	36.12	1.11
601099	太平洋	12.39	6.08	61.59	0.97
300168	万达信息	65.98	24.51	23.90	0.71
601519	大智慧	23.10	117.92	286.10	0.58
002183	怡亚通	28.55	57.91	139.97	0.54
贡献前 5 名样本股					
代码	简称	收盘	涨跌幅%	换手率%	贡献点数
601519	大智慧	23.10	117.92	286.10	19.02
002183	怡亚通	28.55	57.91	139.97	11.89
600528	中铁二局	22.23	44.92	334.30	9.54
300168	万达信息	65.98	24.51	23.90	8.48
600895	张江高科	20.05	29.44	64.16	6.73
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	23.10	117.92	286.10	19.02
600831	广电网络	16.70	80.35	264.36	5.61
002183	怡亚通	28.55	57.91	139.97	11.89
600704	物产中大	15.69	51.16	50.15	6.08
600528	中铁二局	22.23	44.92	334.30	9.54
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
000506	中润资源	5.82	-16.50	64.39	-1.22
002240	威华股份	14.81	-12.42	106.84	-1.17
600685	广船国际	38.70	-9.47	62.97	-1.69
600507	方大特钢	5.25	-9.33	67.25	-0.53
600401	海润光伏	7.70	-7.12	87.13	-0.52

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	70.28	1.43	38.84	2.25
600030	中信证券	29.53	5.99	71.75	1.53
600016	民生银行	9.23	-2.53	19.64	1.23
600036	招商银行	14.70	2.51	20.97	1.07
600000	浦发银行	14.53	0.41	28.81	0.97
贡献前 5 名样本股					
代码	简称	收盘	涨跌幅%	换手率%	贡献点数
600030	中信证券	29.53	5.99	71.75	2.92
600837	海通证券	21.76	9.51	64.09	2.48
300104	乐视网	79.90	65.08	120.62	2.41
601519	大智慧	23.10	117.92	286.10	2.02
600050	中国联通	5.65	25.00	78.97	1.98
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
300364	中文在线	54.57	185.26	140.98	0.24
601519	大智慧	23.10	117.92	286.10	2.02
600318	巢东股份	22.83	103.84	120.00	0.32
600831	广电网络	16.70	80.35	264.36	0.59
300350	华鹏飞	45.94	75.21	238.28	0.11
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
002740	爱迪尔	32.52	-22.63	283.58	-0.05
603788	宁波高发	25.18	-20.62	368.34	-0.05
000506	中润资源	5.82	-16.50	64.39	-0.13
000925	众合机电	23.05	-16.21	54.61	-0.17
000059	华锦股份	9.17	-15.41	82.50	-0.22

附录：部分指标说明

- 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:

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

- 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:

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

- 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。