

# 广发基金指数月报

(2015年3月2日—2015年3月31日)

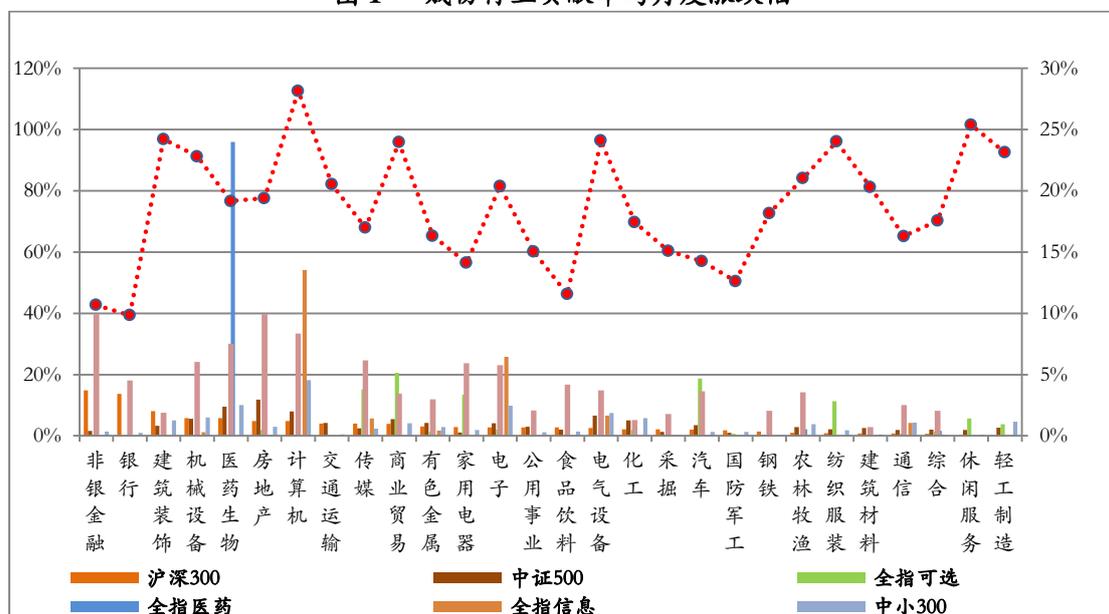
广发基金数量投资部

## 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

本月市场大幅上涨,申万 28 个一级行业全线上涨,计算机行业涨幅达 28.2%。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 14.8%;房地产行业对中证 500 指数贡献最大,贡献率为 19.4%;商业贸易行业对全指可选指数的贡献最大,贡献率为 20.6%;医药生物行业对全指医药贡献率为 96.0%;计算机行业对全指信息指数贡献居首,贡献率为 54.1%;计算机行业对中小 300 指数贡献居首,贡献率为 18.2%;非银金融行业对深证 100 指数贡献最大,贡献率为 9.94%。

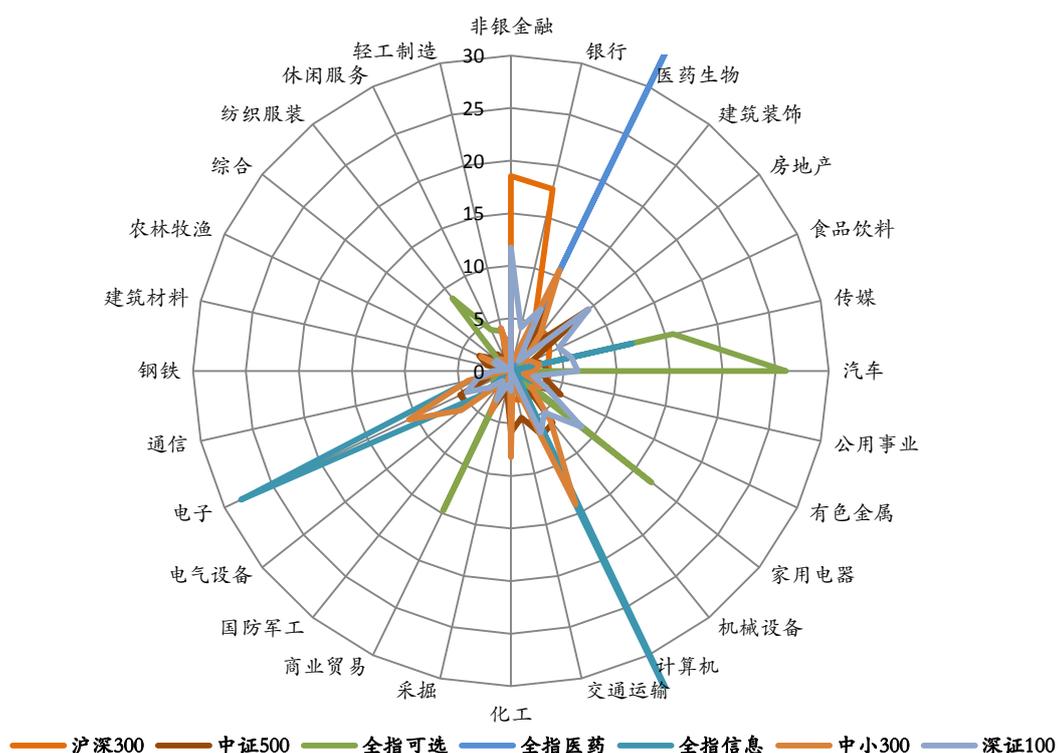
图 1 成份行业贡献率与月度涨跌幅



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 18.5%。房地产、医药生物和计算机行业在中证 500 指数中权重居前,依次为 9.39%、9.20%和 6.80%。汽车、家用电器、传媒在全指可选指

数中权重较大，分别为 25.9%、17.0%、15.7%。计算机、电子和传媒行业在全指信息指数中占比较大，依次为 47.1%、28.3%和 11.7%。计算机、电子、医药生物在中小 300 指数中权重居前，分别为 14.1%、10.7%和 10.6%。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 0.43%。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、广发全指医药卫生 ETF 和广发全指信息技术 ETF 的年化跟踪误差均在 0.9% 以内，取得了良好的跟踪效果。

表 1 基金净值与跟踪误差

基金简称	2015 年 3 月		2015 年 2 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	1.5559	1.5559	1.3023	1.3023	0.3409	2009/11/26
广发沪深 300	1.783	2.073	1.576	1.866	0.7658	2008/12/30

广发中小板 300ETF	1.6013	1.4549	1.3213	1.2005	0.4287	2011/6/3
广发中小板 300 联接	1.4164	1.4164	1.1768	1.1768	0.6285	2011/6/9
广发深证 100 分级	1.2428	1.3307	1.1095	1.1974	1.1085	2012/5/7
广发中证 500ETF	2.0339	2.0339	1.6894	1.6894	0.3230	2013/4/11
广发全指可选消费 ETF	1.7296	1.7296	1.4611	1.4611	0.4180	2014/6/3
广发全指医药卫生 ETF	1.3202	1.3202	1.1187	1.1187	0.8864	2014/12/1
广发全指信息技术 ETF	1.3488	1.3488	1.1023	1.1023	0.8460	2015/1/8

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

3 月沪深两市上涨，覆盖两市的申万 A 指上涨 17.7%。指数方面，本期核心市场指数中，中小板 300 指涨幅居首，上涨 21.8%；上证 50 表现最差，涨幅为 11.32%。

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	2474.60	2495.57	2860.24	2321.27	2754.66	11.32%	33185.89
上证 180	7947.05	8014.68	9254.49	7561.11	8972.90	12.91%	61199.51
深证成指	11757.68	11869.96	13538.29	11169.05	13160.66	11.93%	12860.13
深证 100P	3900.14	3938.23	4500.78	3767.08	4416.14	13.23%	24236.16
中小板指	6630.63	6671.39	8111.67	6567.38	8005.86	20.74%	13422.91
中小板 300	1323.69	1330.51	1629.86	1326.11	1612.10	21.79%	25046.17
创业板指	1928.04	1944.11	2405.56	1932.82	2335.17	21.12%	9656.93
沪深 300	3572.84	3603.45	4166.02	3417.49	4051.20	13.39%	87334.85
中证 500	6018.46	6064.82	7328.85	6039.25	7253.10	20.51%	42921.79
申万 A 指	3351.62	3376.80	3995.00	3315.06	3944.05	17.68%	207422.20

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	<b>4287.84</b>	<b>4218.59</b>	<b>4549.66</b>	<b>4160.42</b>	<b>4540.14</b>	<b>5.88%</b>	<b>73113.90</b>

图3 核心指数月度表现

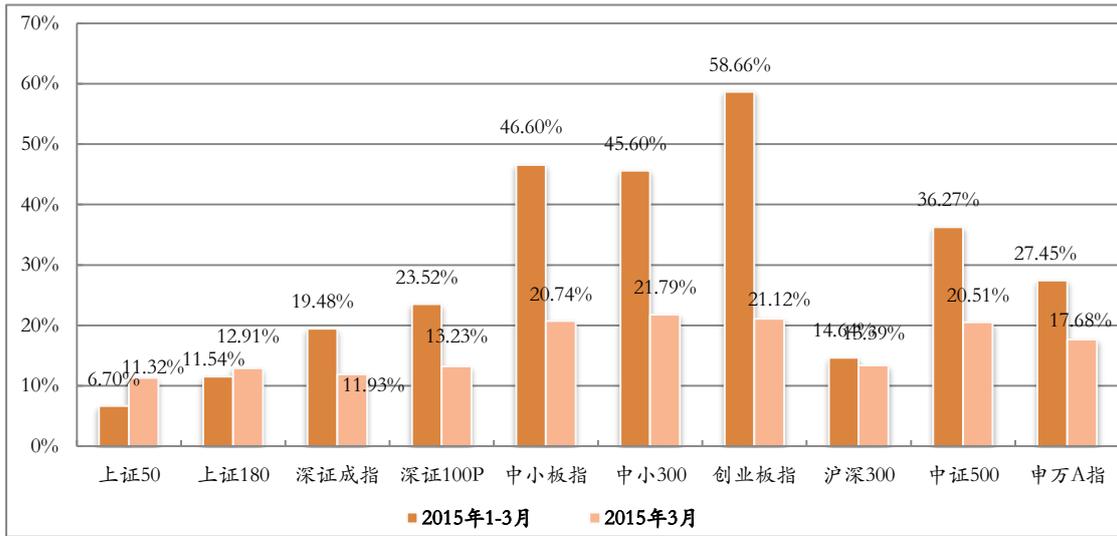


图4 核心指数本月绝对收益

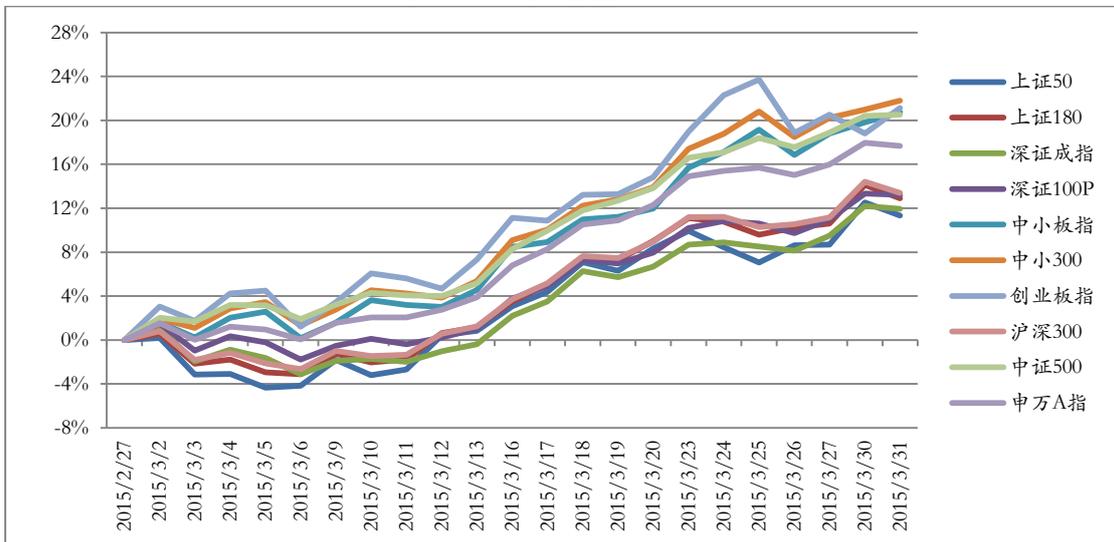
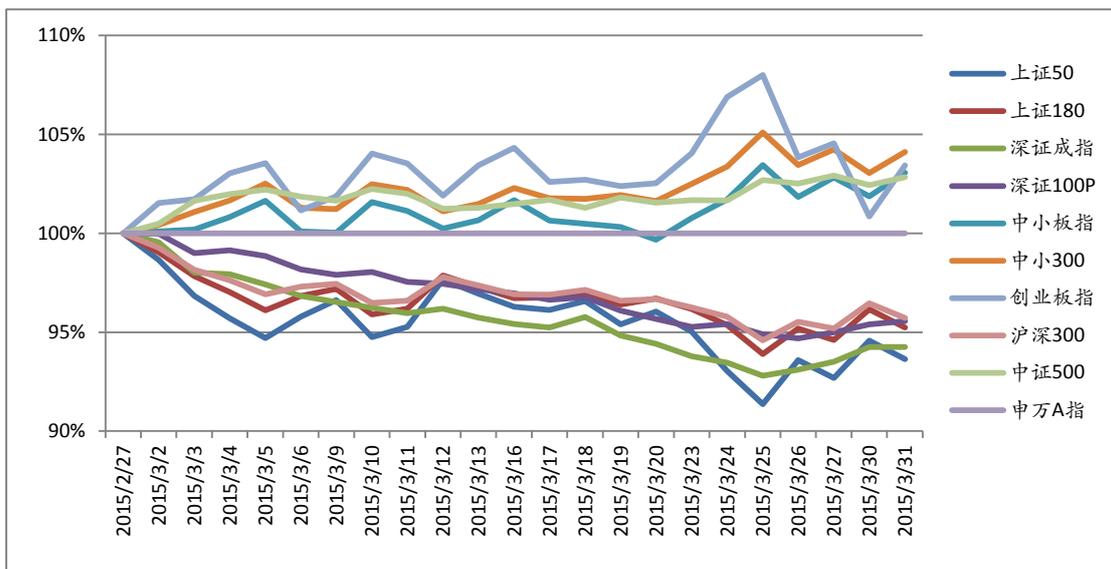


图5 核心指数本月超额收益对比



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

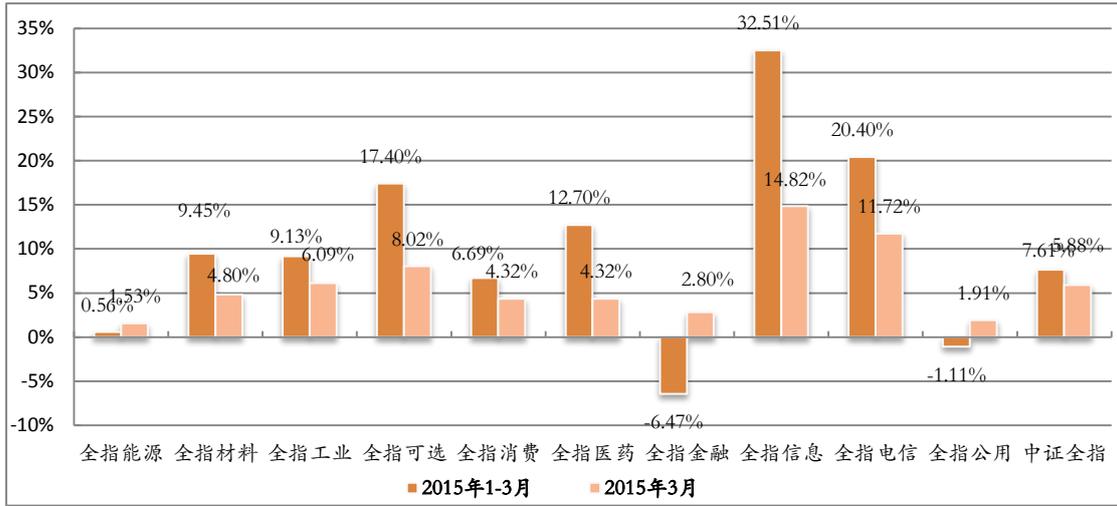


图 7 行业指数本月绝对收益

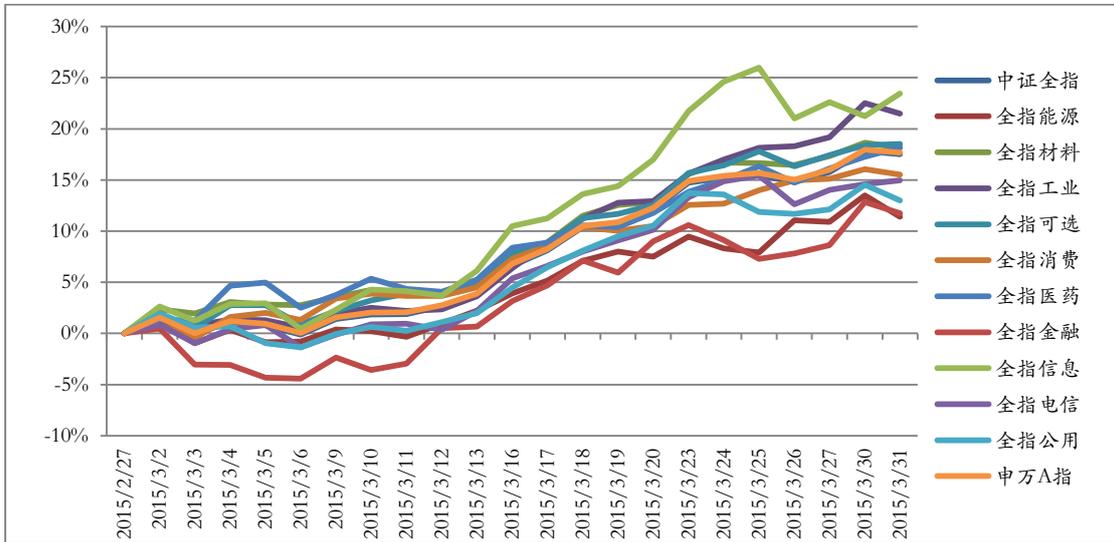
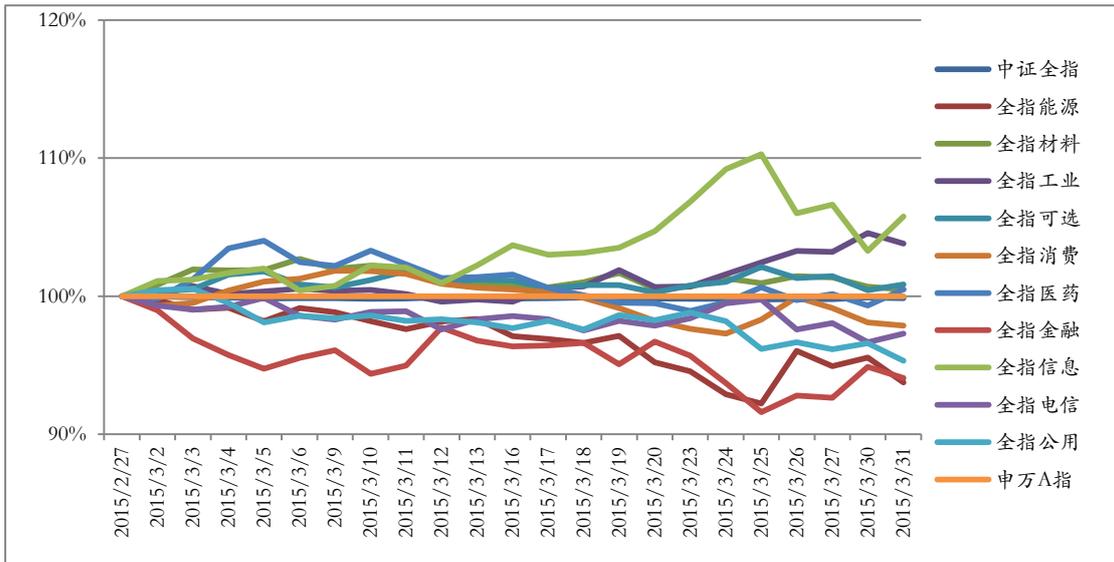


图 8 行业指数本月超额收益对比



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3月份核心指数的估值水平较上月上移明显，市场平均动态（2014年）市盈率为18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11.3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	12.03	11.88	11.30	1.73
上证180	12.83	12.68	12.05	1.85
深证成指	23.11	22.11	20.16	3.18
深证100P	28.05	27.11	24.59	3.39
中小板指数	45.97	43.12	38.74	5.32
中小板300	51.40	49.52	43.29	5.15
创业板指P	88.82	82.75	73.84	9.20
沪深300	14.68	14.48	13.72	2.04
中证500	45.95	44.57	39.06	3.79
申万A指	20.87	20.33	18.01	2.59

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
<b>中证全指</b>	<b>18.09</b>	<b>16.54</b>	<b>14.96</b>	<b>2.20</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	78.24	11.33	78.35	9.66
600016	民生银行	9.70	5.09	44.54	6.28
600030	中信证券	32.82	11.14	119.21	6.17
600036	招商银行	15.57	5.92	47.52	6.14
601166	兴业银行	18.36	28.93	117.86	5.01
贡献前 5 名样本股					
代码	简称	收盘	涨跌幅%	换手率%	贡献点数
601166	兴业银行	18.36	28.93	117.86	30.97
601318	中国平安	78.24	11.33	78.35	27.11
600030	中信证券	32.82	11.14	119.21	17.06
601766	中国南车	16.99	40.18	188.64	15.08
601299	中国北车	18.41	43.38	158.31	14.85
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
601299	中国北车	18.41	43.38	158.31	14.85
601766	中国南车	16.99	40.18	188.64	15.08
600518	康美药业	31.01	37.03	151.84	8.50
601688	华泰证券	30.11	31.03	157.72	13.13
601166	兴业银行	18.36	28.93	117.86	30.97
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
600050	中国联通	5.47	-3.19	104.32	-1.01
601601	中国太保	33.90	-1.48	95.40	-1.03
601628	中国人寿	37.05	-1.09	151.23	-0.18
600028	中国石化	6.41	1.42	132.30	0.53
600104	上汽集团	24.86	2.05	54.49	1.09

## 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	78.24	11.33	78.35	5.87
600016	民生银行	9.70	5.09	44.54	3.82
600030	中信证券	32.82	11.14	119.21	3.75
600036	招商银行	15.57	5.92	47.52	3.73
601166	兴业银行	18.36	28.93	117.86	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
601166	兴业银行	18.36	28.93	117.86	61.32
601318	中国平安	78.24	11.33	78.35	53.35
601390	中国中铁	12.63	47.21	245.76	35.97
600030	中信证券	32.82	11.14	119.21	33.56
601766	中国南车	16.99	40.18	188.64	29.87
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
600177	雅戈尔	18.93	50.24	122.02	12.91
601390	中国中铁	12.63	47.21	245.76	35.97
600037	歌华有线	26.83	46.37	117.43	7.06
601299	中国北车	18.41	43.38	158.31	29.45
600570	恒生电子	108.88	40.65	73.62	20.35
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
600522	中天科技	18.19	-3.76	20.88	-0.57
600050	中国联通	5.47	-3.19	104.32	-2.04
601601	中国太保	33.90	-1.48	95.40	-2.16
603000	人民网	56.11	-1.27	188.51	-0.29
601628	中国人寿	37.05	-1.09	151.23	-0.42

### 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	13.82	8.39	71.19	7.82
000651	格力电器	43.78	8.02	46.32	6.68
000001	平安银行	15.75	12.58	75.87	5.51
000776	广发证券	27.90	18.02	109.53	5.38
000333	美的集团	32.95	4.74	30.27	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
000776	广发证券	27.90	18.02	109.53	108.14
000001	平安银行	15.75	12.58	75.87	80.96
000002	万科 A	13.82	8.39	71.19	79.63
000725	京东方 A	4.03	27.53	200.69	71.68
000024	招商地产	32.94	28.52	161.74	69.56
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
002236	大华股份	36.55	31.85	178.76	41.71
002230	科大讯飞	52.00	30.33	140.65	57.65
000629	攀钢钒钛	4.09	29.43	143.94	30.60
000024	招商地产	32.94	28.52	161.74	69.56
000725	京东方 A	4.03	27.53	200.69	71.68
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
000625	长安汽车	20.29	-5.72	11.89	-22.09
000768	中航飞机	27.16	0.48	130.01	1.28
002304	洋河股份	81.37	1.23	48.63	2.26
300027	华谊兄弟	31.28	2.26	143.27	4.90
002594	比亚迪	52.40	3.60	129.00	8.59

#### 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	13.82	8.39	71.19	4.73
000651	格力电器	43.78	8.02	46.32	4.04
000001	平安银行	15.75	12.58	75.87	3.33
000776	广发证券	27.90	18.02	109.53	3.26
000333	美的集团	32.95	4.74	30.27	2.72
贡献前 5 名样本股					
代码	简称	收盘	涨跌幅%	换手率%	贡献点数
000776	广发证券	27.90	18.02	109.53	21.98
000001	平安银行	15.75	12.58	75.87	16.46
000002	万科 A	13.82	8.39	71.19	16.19
000725	京东方 A	4.03	27.53	200.69	14.57
000024	招商地产	32.94	28.52	161.74	14.14
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
002030	达安基因	42.90	51.38	218.11	9.13
002405	四维图新	40.80	40.69	117.54	10.58
002344	海宁皮城	23.83	37.75	157.76	5.41
002385	大北农	24.20	34.59	142.11	8.68
300058	蓝色光标	36.45	34.01	161.22	9.26
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
000625	长安汽车	20.29	-5.72	11.89	-4.49
000831	五矿稀土	33.09	-2.01	139.52	-0.70
000046	泛海控股	13.80	-1.85	112.83	-0.52
000728	国元证券	34.27	0.20	214.59	0.13
000768	中航飞机	27.16	0.48	130.01	0.26

## 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	13.07	11.90	130.13	4.34
002415	海康威视	30.70	3.79	77.92	3.30
002081	金螳螂	35.17	22.37	66.12	2.44
002202	金风科技	19.06	29.57	95.36	2.43
002450	康得新	38.15	6.74	61.58	2.39
贡献前 5 名样本股					
代码	简称	收盘	涨跌幅%	换手率%	贡献点数
002152	广电运通	39.17	76.84	77.91	51.41
002202	金风科技	19.06	29.57	95.36	44.48
002230	科大讯飞	52.00	30.33	140.65	43.14
002405	四维图新	40.80	40.69	117.54	38.93
002024	苏宁云商	13.07	11.90	130.13	36.96
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
002312	三泰控股	44.60	86.69	185.54	32.59
002152	广电运通	39.17	76.84	77.91	51.41
002063	远光软件	40.04	67.60	136.40	35.04
002251	步步高	27.10	60.55	148.13	17.82
002229	鸿博股份	27.70	52.37	280.18	10.76
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
002304	洋河股份	81.37	1.23	48.63	1.69
002475	立讯精密	38.90	2.34	71.69	1.77
002594	比亚迪	52.40	3.60	129.00	6.43
002415	海康威视	30.70	3.79	77.92	9.65
002052	同洲电子	12.91	4.62	149.51	2.05

## 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	13.07	11.90	130.13	2.46
002415	海康威视	30.70	3.79	77.92	1.87
002081	金螳螂	35.17	22.37	66.12	1.38
002202	金风科技	19.06	29.57	95.36	1.38
002450	康得新	38.15	6.74	61.58	1.35
贡献前 5 名样本股					
代码	简称	收盘	涨跌幅%	换手率%	贡献点数
002152	广电运通	39.17	76.84	77.91	5.86
002202	金风科技	19.06	29.57	95.36	5.07
002230	科大讯飞	52.00	30.33	140.65	4.92
002405	四维图新	40.80	40.69	117.54	4.44
002285	世联行	38.78	82.07	130.50	4.43
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
002055	得润电子	33.99	137.19	244.94	3.72
002195	二三四五	63.30	100.37	398.73	3.68
002312	三泰控股	44.60	86.69	185.54	3.72
002093	国脉科技	14.33	82.08	365.44	1.80
002285	世联行	38.78	82.07	130.50	4.43
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
002095	生意宝	82.76	-5.07	325.40	-0.28
002108	沧州明珠	21.89	-1.93	218.63	-0.07
002466	天齐锂业	56.83	-1.81	157.17	-0.03
002304	洋河股份	81.37	1.23	48.63	0.19
002035	华帝股份	14.71	2.15	98.98	0.05

## 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%
300104	乐视网	93.72	17.30	168.56	4.02
300059	东方财富	29.42	0.00	0.00	3.90
300027	华谊兄弟	31.28	2.26	143.27	3.03
300024	机器人	51.95	18.50	148.05	2.99
300070	碧水源	43.34	17.23	82.73	2.90
贡献前 5 名样本股					
代码	简称	收盘	涨跌幅%	换手率%	贡献点数
300253	卫宁软件	163.10	55.17	102.88	21.81
300055	万邦达	108.48	108.14	249.68	17.07
300170	汉得信息	38.01	67.96	210.13	16.53
300144	宋城演艺	57.54	91.04	47.87	15.57
300058	蓝色光标	36.45	34.01	161.22	14.50
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
300055	万邦达	108.48	108.14	249.68	17.07
300144	宋城演艺	57.54	91.04	47.87	15.57
300170	汉得信息	38.01	67.96	210.13	16.53
300074	华平股份	26.00	62.81	305.94	5.64
300363	博腾股份	53.00	60.76	194.02	4.03
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
300011	鼎汉技术	24.25	-5.83	91.68	-0.86
300037	新宙邦	36.16	-5.46	169.32	-0.48
300226	上海钢联	116.20	-4.75	128.89	-1.49
300027	华谊兄弟	31.28	2.26	143.27	1.56
300147	香雪制药	23.00	3.84	85.57	0.80

## 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	78.24	11.33	78.35	4.14
600016	民生银行	9.70	5.09	44.54	2.69
600030	中信证券	32.82	11.14	119.21	2.65
600036	招商银行	15.57	5.92	47.52	2.63
601166	兴业银行	18.36	28.93	117.86	2.15
贡献前 5 名样本股					
代码	简称	收盘	涨跌幅%	换手率%	贡献点数
601166	兴业银行	18.36	28.93	117.86	19.56
601318	中国平安	78.24	11.33	78.35	17.01
601390	中国中铁	12.63	47.21	245.76	11.47
600030	中信证券	32.82	11.14	119.21	10.70
601766	中国南车	16.99	40.18	188.64	9.55
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
600415	小商品城	25.74	73.80	101.05	6.16
600029	南方航空	7.92	52.60	200.70	3.97
600177	雅戈尔	18.93	50.24	122.02	4.09
601390	中国中铁	12.63	47.21	245.76	11.47
000413	东旭光电	11.80	44.25	281.90	2.52
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
000625	长安汽车	20.29	-5.72	11.89	-1.15
601231	环旭电子	37.44	-5.53	131.41	-0.12
600050	中国联通	5.47	-3.19	104.32	-0.64
000831	五矿稀土	33.09	-2.01	139.52	-0.18
601601	中国太保	33.90	-1.48	95.40	-0.71

## 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	29.42	0.00	0.00	0.92
601099	太平洋	13.83	11.62	146.76	0.90
600219	南山铝业	10.82	18.38	280.30	0.65
000540	中天城投	35.78	97.79	219.92	0.65
601519	大智慧	29.56	27.97	447.82	0.62
贡献前 5 名样本股					
代码	简称	收盘	涨跌幅%	换手率%	贡献点数
000540	中天城投	35.78	97.79	219.92	23.12
601012	隆基股份	51.69	94.69	243.03	15.56
300144	宋城演艺	57.54	91.04	47.87	14.57
300253	卫宁软件	163.10	55.17	102.88	14.29
002285	世联行	38.78	82.07	130.50	12.74
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
601010	文峰股份	29.40	136.15	439.85	7.15
000829	天音控股	18.35	99.46	310.86	11.55
000066	长城电脑	17.43	98.29	226.12	10.87
000540	中天城投	35.78	97.79	219.92	23.12
601012	隆基股份	51.69	94.69	243.03	15.56
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
603005	晶方科技	55.48	-7.61	115.07	-0.60
000975	银泰资源	17.84	-6.40	133.18	-1.01
600522	中天科技	18.19	-3.76	20.88	-0.80
600831	广电网络	16.65	-0.30	367.29	-0.03
000997	新大陆	38.87	-0.21	147.69	-0.07

## 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	78.24	11.33	78.35	2.09
600030	中信证券	32.82	11.14	119.21	1.42
600016	民生银行	9.70	5.09	44.54	1.08
601166	兴业银行	18.36	28.93	117.86	1.00
600036	招商银行	15.57	5.92	47.52	0.95
贡献前 5 名样本股					
代码	简称	收盘	涨跌幅%	换手率%	贡献点数
601166	兴业银行	18.36	28.93	117.86	8.89
601318	中国平安	78.24	11.33	78.35	8.45
600030	中信证券	32.82	11.14	119.21	5.65
601390	中国中铁	12.63	47.21	245.76	4.21
601688	华泰证券	30.11	31.03	157.72	3.89
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
002055	得润电子	33.99	137.19	244.94	1.02
601010	文峰股份	29.40	136.15	439.85	0.65
002256	彩虹精化	22.44	123.06	272.97	0.53
300081	恒信移动	56.75	122.99	216.71	0.52
002622	永大集团	29.10	122.66	487.26	0.43
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
002676	顺威股份	21.63	-13.48	296.04	-0.03
603799	华友钴业	20.18	-11.68	362.47	-0.05
603005	晶方科技	55.48	-7.61	115.07	-0.06
300397	天和防务	90.27	-7.57	143.38	-0.05
600272	开开实业	16.96	-7.17	155.09	-0.03

## 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。