

广发基金指数月报

(2015年4月1日—2015年4月30日)

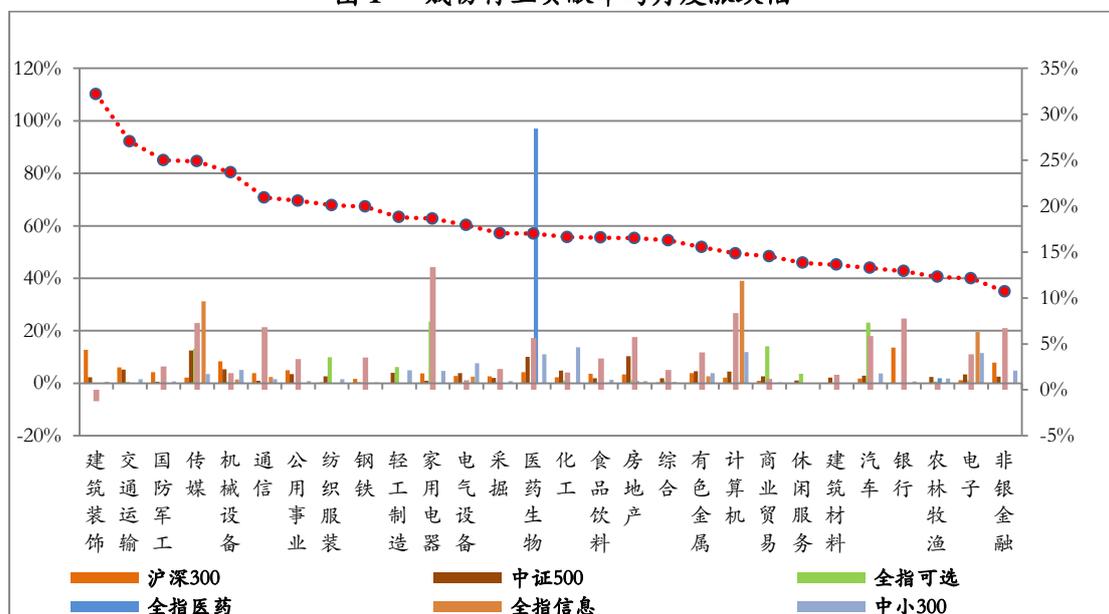
广发基金数量投资部

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

本月市场继续上行，申万 28 个一级行业全部上涨，建筑装饰行业涨幅高达 32.18%。从各指数成份股的行业贡献率来看，银行业对沪深 300 指数影响最大，贡献率为 13.65%；传媒行业对中证 500 指数贡献最大，贡献率为 12.54%；家用电器行业对全指可选指数的贡献最大，贡献率为 23.51%；医药生物行业对全指医药贡献率为 97.09%；计算机行业对全指信息指数贡献居首，贡献率为 39.09%；化工行业对中小 300 指数贡献居首，贡献率为 13.72%；家用电器行业对深证 100 指数贡献最大，贡献率为 13.35%。

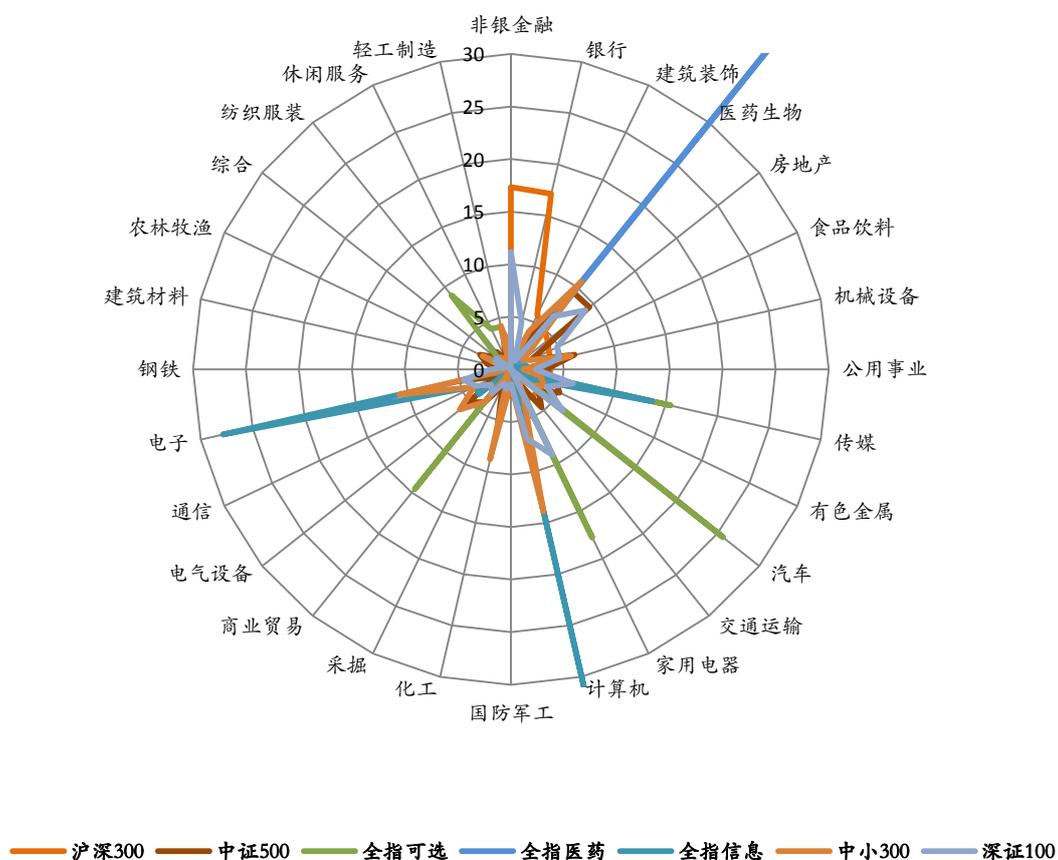
图 1 成份行业贡献率与月度涨跌幅



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 17.33%。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 9.49%、9.40%和 6.49%。汽车、家用电器、传媒在全指可选

指数中权重较大，分别为 25.65%、17.76%、15.5%。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 45.98%、27.86%和 13.69%。计算机、电子、医药生物在中小 300 指数中权重居前，分别为 13.85%、10.76%和 10.67%。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 11.17%、9.05%和 9.02%。

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 0.456%。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 1.8% 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 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	1.813	1.813	1.5559	1.5559	1.2276	2009/11/26
广发沪深 300	2.08	2.37	1.783	2.073	1.7681	2008/12/30
广发中小板 300ETF	1.781	1.6181	1.6013	1.4549	0.4564	2011/6/3
广发中小板 300 联接	1.5667	1.5667	1.4164	1.4164	1.2131	2011/6/9
广发深证 100 分级	1.4022	1.4901	1.2428	1.3307	1.4041	2012/5/7
广发中证 500ETF	2.3816	2.3816	2.0339	2.0339	0.5149	2013/4/11
广发全指可选消费 ETF	1.9842	1.9842	1.7296	1.7296	1.0157	2014/6/3
广发全指医药卫生 ETF	1.525	1.525	1.3202	1.3202	0.9933	2014/12/1
广发全指信息技术 ETF	1.5665	1.5665	1.3488	1.3488	1.1213	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

4 月沪深两市上涨，覆盖两市的申万 A 指上涨 17.29%。指数方面，本期核心市场指数中，创业板指涨幅居首，上涨 22.38%；中小板指表现最差，涨幅为 9.63%。

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	2754.66	2758.96	3370.03	2746.30	3250.49	18.00%	54144.14
上证 180	8972.90	8985.45	10863.08	8959.18	10608.55	18.23%	97220.76
深证成指	13160.66	13187.42	15009.73	13142.40	14818.64	12.60%	18314.54
深证 100P	4416.14	4425.76	5074.93	4417.23	4988.90	12.97%	33399.90
中小板指	8005.86	8026.96	9070.93	7993.34	8777.18	9.63%	15905.64
中小板 300	1612.10	1615.41	1842.68	1615.41	1798.75	11.58%	30640.65
创业板指	2335.17	2347.00	2918.75	2345.75	2857.89	22.38%	11839.44
沪深 300	4051.20	4057.50	4839.08	4046.94	4749.89	17.25%	135975.87
中证 500	7253.10	7258.83	8576.48	7258.74	8469.67	16.77%	59592.87

申万 A 指	3944.05	3948.21	4680.36	3946.71	4625.87	17.29%	299176.22
--------	---------	---------	---------	---------	---------	--------	-----------

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	2625.74	2620.13	3338.94	2614.64	3120.85	18.86%	9829.92
全指材料	3624.84	3624.41	4287.03	3622.65	4199.86	15.86%	33412.45
全指工业	4870.39	4873.70	6175.64	4872.86	6082.62	24.89%	72749.42
全指可选	6313.62	6319.50	7325.30	6319.40	7215.56	14.29%	29897.12
全指消费	8203.73	8210.12	9802.11	8209.83	9498.95	15.79%	12371.72
全指医药	9916.44	9937.96	11672.41	9933.13	11469.43	15.66%	10841.01
全指金融	6440.22	6457.22	7437.85	6403.49	7212.28	11.99%	54682.71
全指信息	7178.11	7185.05	8547.78	7181.78	8393.92	16.94%	28909.36
全指电信	5985.33	5992.70	7134.94	5992.51	7032.62	17.50%	5405.12
全指公用	3119.21	3117.00	3887.55	3114.92	3836.29	22.99%	10321.90
中证全指	5335.49	5340.98	6333.42	5337.01	6258.61	17.30%	289513.29

图3 核心指数月度表现

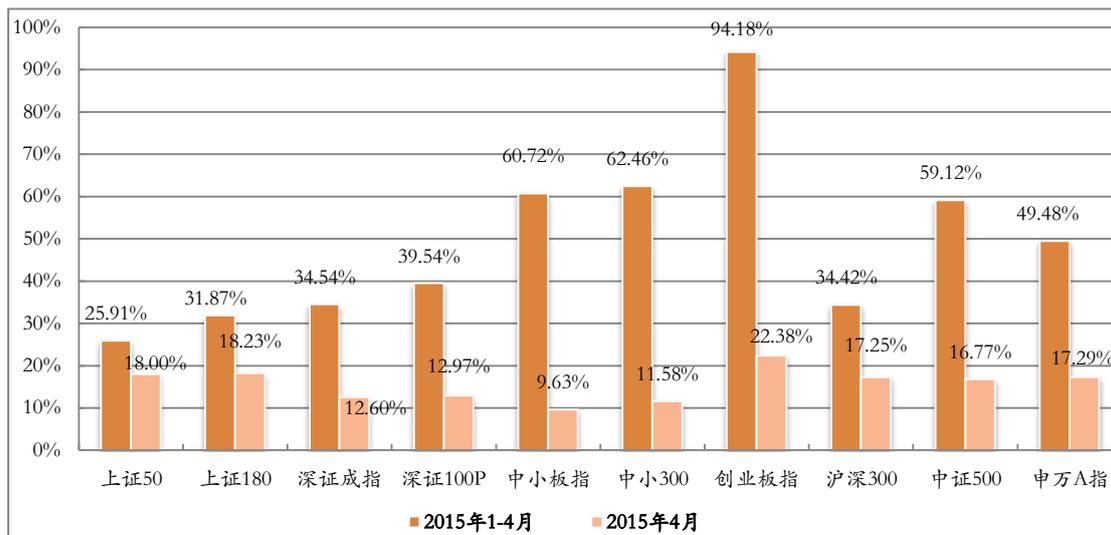


图4 核心指数本月绝对收益

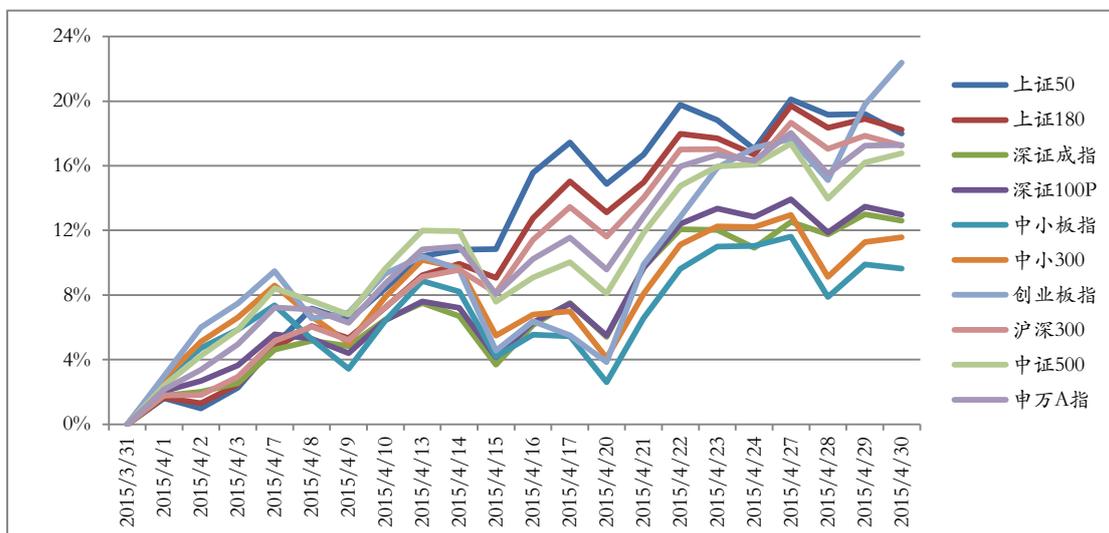
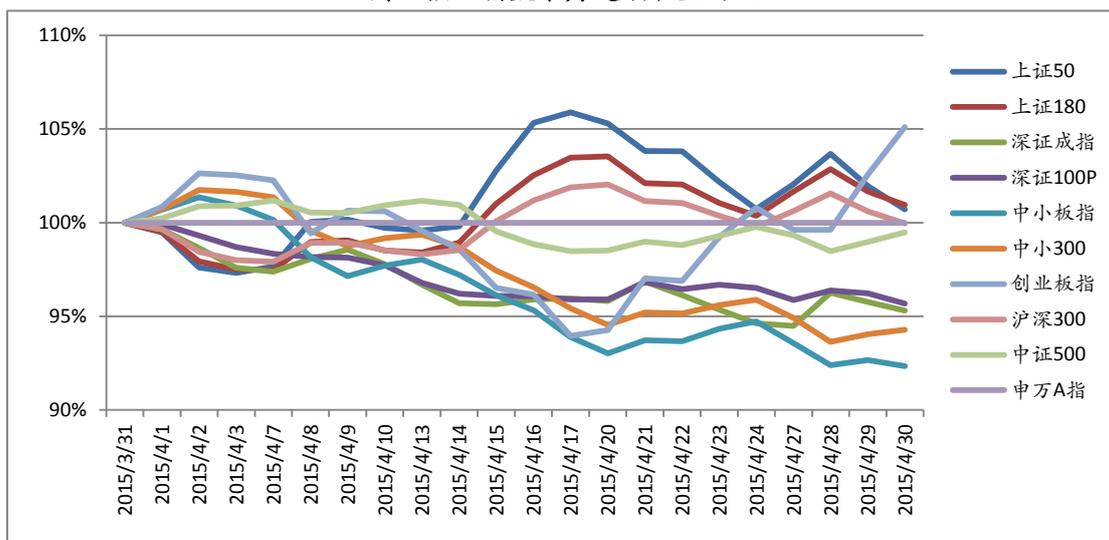


图5 核心指数本月超额收益对比



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

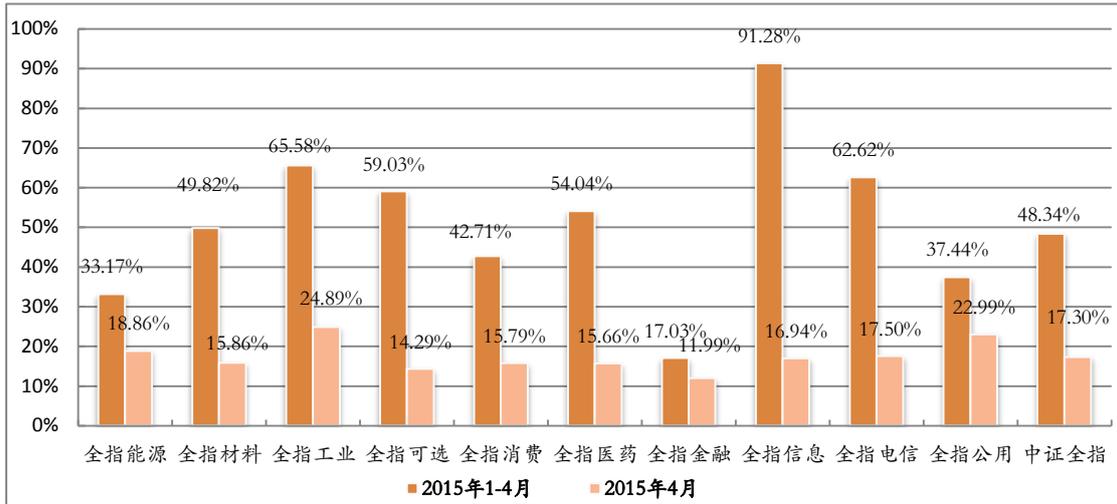


图 7 行业指数本月绝对收益

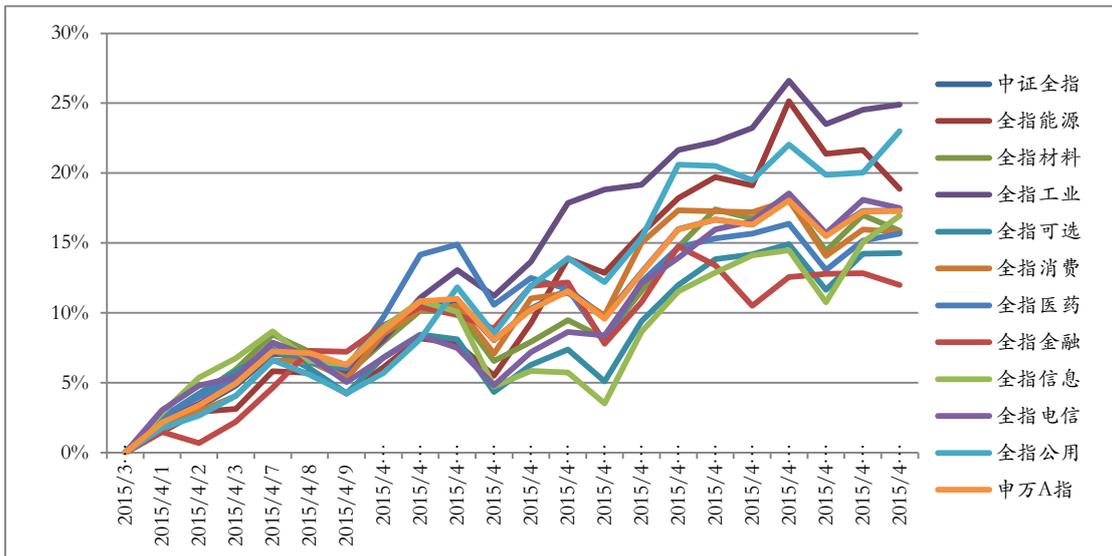
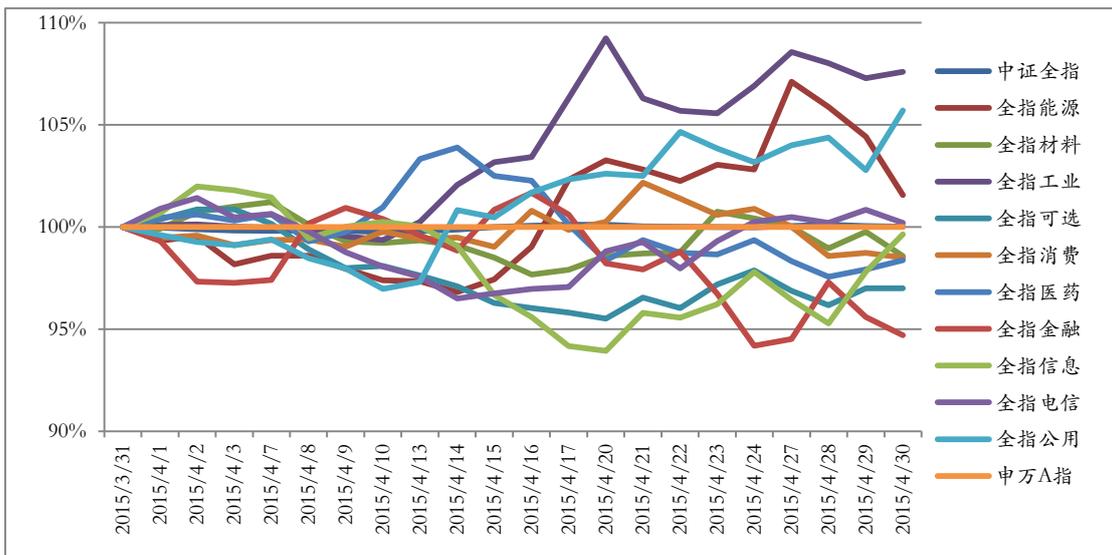


图 8 行业指数本月超额收益对比



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 4 月份核心指数的估值水平较上月继续上移，市场平均动态（2015 年）市盈率为 19.7 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 13.1 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	13.78	13.84	13.06	1.89
上证 180	14.82	14.70	13.74	2.04
深证成指	24.45	23.11	19.23	3.39
深证 100P	30.35	28.50	23.35	3.68
中小板指数	47.62	45.40	35.36	5.71
中小板 300	55.53	52.34	37.11	5.61
创业板指 P	100.41	98.44	63.31	10.80
沪深 300	16.87	16.57	15.30	2.25
中证 500	52.71	50.29	36.00	4.29
申万 A 指	24.17	23.38	19.65	2.91

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	23.21	29.29	31.91	1.96
全指材料	51.11	48.88	34.67	3.27
全指工业	47.36	44.79	32.99	4.17
全指可选	32.59	31.23	22.93	4.01
全指消费	36.96	34.57	27.78	4.56
全指医药	56.23	52.91	39.16	6.24
全指金融	11.28	10.89	10.07	1.73
全指信息	94.49	88.55	57.58	7.89
全指电信	65.26	61.41	41.63	4.51
全指公用	23.06	21.60	18.96	2.86
中证全指	23.53	22.79	19.23	2.84

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	88.66	13.32	87.85	9.28
600036	招商银行	18.22	17.02	54.13	6.09
600016	民生银行	10.62	9.48	60.37	5.83
600030	中信证券	34.36	4.69	135.49	5.47
600837	海通证券	28.61	22.21	155.00	4.69
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	31.70	86.58	202.97	45.66
601299	中国北车	32.56	76.86	166.65	37.70
601318	中国平安	88.66	13.32	87.85	33.10
601668	中国建筑	10.90	42.11	243.70	31.78
600036	招商银行	18.22	17.02	54.13	28.78
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	31.70	86.58	202.97	45.66
601299	中国北车	32.56	76.86	166.65	37.70
600050	中国联通	9.52	74.04	234.55	22.63
601989	中国重工	14.56	45.02	270.62	20.84
600832	东方明珠	23.18	42.82	174.00	7.28
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
600109	国金证券	24.90	-2.40	181.07	-1.20
601688	华泰证券	29.13	-1.65	155.31	-2.04
601601	中国太保	34.82	2.71	111.88	1.70
601628	中国人寿	38.06	2.73	168.85	1.05
600703	三安光电	22.10	3.95	134.71	0.76

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	88.66	13.32	87.85	5.63
600036	招商银行	18.22	17.02	54.13	3.69
600016	民生银行	10.62	9.48	60.37	3.54
600030	中信证券	34.36	4.69	135.49	3.32
600837	海通证券	28.61	22.21	155.00	2.84
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
601618	中国中冶	11.03	96.61	374.00	34.46
601766	中国南车	31.70	86.58	202.97	90.39
601669	中国电建	18.28	84.83	173.67	31.97
601299	中国北车	32.56	76.86	166.65	74.75
600050	中国联通	9.52	74.04	234.55	44.98
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
600490	鹏欣资源	14.29	-6.23	164.15	-1.27
600718	东软集团	26.86	-4.45	124.23	-0.93
600717	天津港	20.30	-3.06	171.16	-0.54
601933	永辉超市	11.21	-2.78	85.02	-0.64
600109	国金证券	24.90	-2.40	181.07	-2.38

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%
000651	格力电器	57.00	30.20	76.58	7.72
000002	万科 A	14.60	5.64	109.06	7.33
000001	平安银行	16.70	28.33	104.17	6.22
000776	广发证券	28.21	1.11	107.55	4.83
000333	美的集团	36.97	15.28	52.77	4.47
贡献前 5 名样本股					
代码	简称	收盘	涨跌幅%	换手率%	贡献点数
000651	格力电器	57.00	30.20	76.58	265.32
000001	平安银行	16.70	28.33	104.17	205.07
000063	中兴通讯	31.15	42.50	176.92	150.14
300104	乐视网	131.79	40.62	173.07	119.83
002230	科大讯飞	48.90	41.36	77.66	102.42
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
000063	中兴通讯	31.15	42.50	176.92	150.14
002230	科大讯飞	48.90	41.36	77.66	102.42
300104	乐视网	131.79	40.62	173.07	119.83
000629	攀钢钒钛	5.35	30.81	211.84	41.46
000651	格力电器	57.00	30.20	76.58	265.32
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
002081	金螳螂	30.39	-13.59	62.13	-35.44
000024	招商地产	31.96	-2.98	18.78	-9.33
000792	盐湖股份	28.68	-2.68	91.04	-4.22
002241	歌尔声学	32.71	-1.77	88.97	-3.73
002353	杰瑞股份	37.88	-1.48	169.89	-1.94

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%
000651	格力电器	57.00	30.20	76.58	4.66
000002	万科 A	14.60	5.64	109.06	4.43
000001	平安银行	16.70	28.33	104.17	3.76
000776	广发证券	28.21	1.11	107.55	2.92
000333	美的集团	36.97	15.28	52.77	2.70
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	57.00	30.20	76.58	53.93
000001	平安银行	16.70	28.33	104.17	41.68
000063	中兴通讯	31.15	42.50	176.92	30.52
300104	乐视网	131.79	40.62	173.07	24.36
002230	科大讯飞	48.90	41.36	77.66	20.82
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
300002	神州泰岳	34.05	45.64	158.16	12.28
000060	中金岭南	18.24	43.06	165.23	12.88
000012	南玻 A	15.49	42.50	45.53	9.67
000063	中兴通讯	31.15	42.50	176.92	30.52
002230	科大讯飞	48.90	41.36	77.66	20.82
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
300058	蓝色光标	30.44	-16.49	172.44	-6.02
002081	金螳螂	30.39	-13.59	62.13	-7.20
002405	四维图新	37.55	-7.97	135.05	-2.91
002073	软控股份	18.84	-5.80	141.92	-1.27
000425	徐工机械	14.71	-3.86	170.64	-1.63

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	13.10	0.23	141.12	3.97
002415	海康威视	32.75	8.03	83.32	3.21
002230	科大讯飞	48.90	41.36	77.66	2.98
002450	康得新	46.92	22.99	80.79	2.68
002594	比亚迪	60.00	14.50	95.33	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
002230	科大讯飞	48.90	41.36	77.66	76.64
002673	西部证券	63.40	41.20	265.41	50.49
002129	中环股份	23.78	49.03	79.12	47.09
002450	康得新	46.92	22.99	80.79	43.89
002008	大族激光	27.05	30.36	207.39	33.57
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
002129	中环股份	23.78	49.03	79.12	47.09
002230	科大讯飞	48.90	41.36	77.66	76.64
002673	西部证券	63.40	41.20	265.41	50.49
002229	鸿博股份	37.15	34.12	178.38	10.68
002292	奥飞动漫	58.69	33.45	124.60	18.25
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
002081	金螳螂	30.39	-13.59	62.13	-26.52
002400	省广股份	37.34	-8.88	84.08	-10.23
002410	广联达	38.19	-7.98	93.94	-9.72
002405	四维图新	37.55	-7.97	135.05	-10.72
002079	苏州固锴	10.49	-5.92	175.55	-1.87

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	13.10	0.23	141.12	2.21
002415	海康威视	32.75	8.03	83.32	1.79
002230	科大讯飞	48.90	41.36	77.66	1.66
002450	康得新	46.92	22.99	80.79	1.49
002594	比亚迪	60.00	14.50	95.33	1.34
贡献前 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	48.90	41.36	77.66	8.74
002673	西部证券	63.40	41.20	265.41	5.74
002129	中环股份	23.78	49.03	79.12	5.37
002450	康得新	46.92	22.99	80.79	5.00
002261	拓维信息	42.90	135.71	40.11	4.00
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
002261	拓维信息	42.90	135.71	40.11	4.00
002298	鑫龙电器	19.80	120.74	110.60	2.49
002411	九九久	19.29	97.04	43.37	1.85
002681	奋达科技	91.30	76.09	264.60	2.34
002174	游族网络	83.65	69.44	153.14	1.14
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
002432	九安医疗	31.89	-16.43	157.80	-0.85
002081	金螳螂	30.39	-13.59	62.13	-3.03
002195	二三四五	56.45	-10.82	304.72	-0.80
002400	省广股份	37.34	-8.88	84.08	-1.17
002678	珠江钢琴	17.26	-8.48	111.22	-0.19

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	83.95	185.35	22.13	8.76
300104	乐视网	131.79	40.62	173.07	4.45
300168	万达信息	105.38	59.71	71.87	3.18
300027	华谊兄弟	34.99	12.20	147.52	2.67
300024	机器人	58.13	11.90	147.73	2.63
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	83.95	185.35	22.13	162.56
300104	乐视网	131.79	40.62	173.07	36.74
300168	万达信息	105.38	59.71	71.87	33.93
300033	同花顺	108.68	79.71	218.97	24.02
300002	神州泰岳	34.05	45.64	158.16	18.53
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
300059	东方财富	83.95	185.35	22.13	162.56
300171	东富龙	77.65	88.47	119.69	11.02
300033	同花顺	108.68	79.71	218.97	24.02
300244	迪安诊断	109.36	73.37	84.10	17.03
300168	万达信息	105.38	59.71	71.87	33.93
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
300058	蓝色光标	30.44	-16.49	172.44	-9.08
300363	博腾股份	45.31	-14.51	191.30	-1.49
300071	华谊嘉信	21.08	-12.78	229.09	-1.44
300238	冠昊生物	35.46	-10.11	131.77	-1.80
300170	汉得信息	34.57	-9.05	125.91	-3.56

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	88.66	13.32	87.85	4.01
600036	招商银行	18.22	17.02	54.13	2.63
600016	民生银行	10.62	9.48	60.37	2.52
600030	中信证券	34.36	4.69	135.49	2.36
600837	海通证券	28.61	22.21	155.00	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
601766	中国南车	31.70	86.58	202.97	28.73
601390	中国中铁	21.31	68.73	351.20	25.23
601299	中国北车	32.56	76.86	166.65	23.81
601318	中国平安	88.66	13.32	87.85	20.91
601668	中国建筑	10.90	42.11	243.70	20.08
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
601866	中海集运	11.10	109.44	357.89	7.68
601618	中国中冶	11.03	96.61	374.00	10.96
601766	中国南车	31.70	86.58	202.97	28.73
601669	中国电建	18.28	84.83	173.67	10.19
600688	上海石化	9.79	78.65	160.10	3.92
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
300058	蓝色光标	30.44	-16.49	165.98	-1.48
002081	金螳螂	30.39	-13.59	59.28	-1.59
002400	省广股份	37.34	-8.88	81.32	-0.72
002410	广联达	38.19	-7.98	89.11	-0.84
000156	华数传媒	45.36	-7.43	85.47	-0.12

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	83.95	185.35	22.13	2.24
300168	万达信息	105.38	59.71	71.74	0.81
601099	太平洋	14.38	3.98	191.31	0.80
600219	南山铝业	11.84	9.43	192.36	0.60
601519	大智慧	33.48	13.26	167.89	0.60
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	83.95	185.35	22.13	123.12
000616	海航投资	12.41	160.17	1.86	20.77
300168	万达信息	105.38	59.71	71.74	20.53
600978	宜华木业	16.01	70.32	178.72	13.78
600021	上海电力	26.43	62.75	294.20	12.58
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
300059	东方财富	83.95	185.35	22.13	123.12
000616	海航投资	12.41	160.17	1.86	20.77
600654	中安消	19.00	82.87	128.53	9.32
600122	宏图高科	15.65	72.36	165.33	10.08
600978	宜华木业	16.01	70.32	178.72	13.78
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
600536	中国软件	44.23	-14.37	170.83	-3.22
000066	长城电脑	15.62	-10.38	165.95	-1.91
002678	珠江钢琴	17.26	-8.48	103.62	-0.57
002612	朗姿股份	37.37	-8.43	32.71	-0.41
000540	中天城投	13.07	-8.15	174.77	-3.16

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	88.66	13.32	90.54	2.00
600030	中信证券	34.36	4.69	142.84	1.26
600016	民生银行	10.62	9.48	62.08	1.00
600036	招商银行	18.22	17.02	54.13	0.93
601166	兴业银行	19.41	5.72	92.80	0.89
贡献前 5 名样本股					
代码	简称	收盘	涨跌幅%	换手率%	贡献点数
300059	东方财富	83.95	185.35	22.13	12.56
601766	中国南车	31.70	86.58	202.97	11.26
601318	中国平安	88.66	13.32	90.54	10.94
601299	中国北车	32.56	76.86	166.65	9.71
601390	中国中铁	21.31	68.73	359.19	8.91
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
300431	暴风科技	122.54	639.98	13.98	0.70
002625	龙生股份	43.05	314.74	141.19	0.94
002747	埃斯顿	70.42	268.88	291.91	0.34
000971	蓝鼎控股	28.45	204.28	143.67	0.67
300059	东方财富	83.95	185.35	22.13	12.56
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
002735	王子新材	41.31	-19.00	211.97	-0.04
300058	蓝色光标	30.44	-16.49	172.44	-0.73
002432	九安医疗	31.89	-16.43	157.80	-0.23
300036	超图软件	47.12	-15.13	115.18	-0.14
002473	圣莱达	30.30	-14.67	175.78	-0.07

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。