

广发基金指数月报

(2015 年 5 月 4 日—2015 年 5 月 29 日)

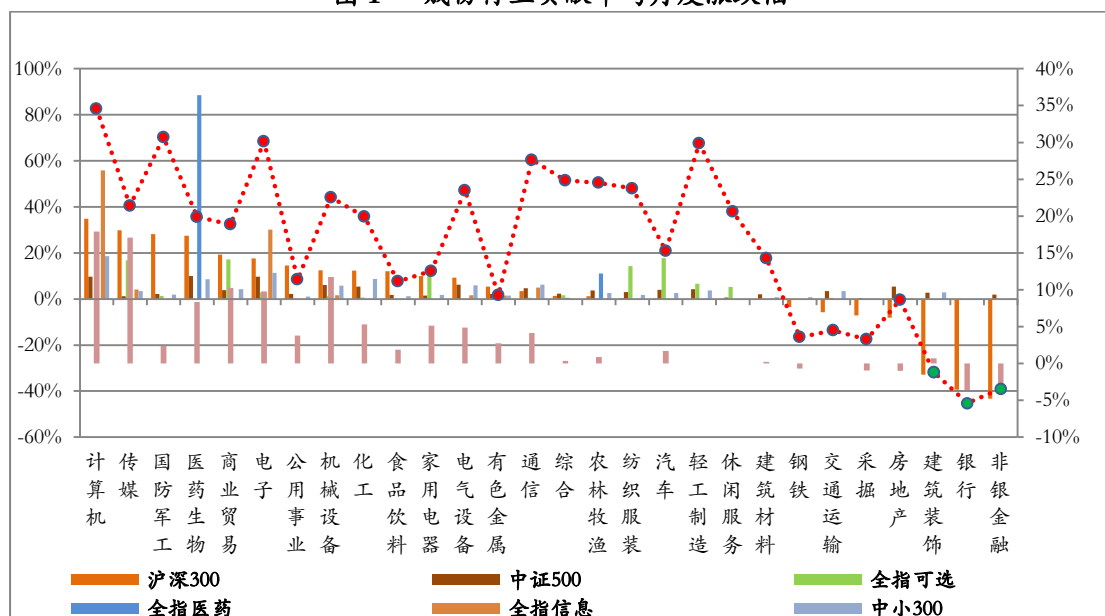
广发基金数量投资部

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

本月市场持续上行，申万 28 个一级行业涨多跌少，计算机行业涨幅居首，高达 34.56%。从各指数成份股的行业贡献率来看，计算机行业对沪深 300 指数影响最大，贡献率为 34.89%；医药生物行业对中证 500 指数贡献最大，贡献率为 10.01%；汽车行业对全指可选指数的贡献最大，贡献率为 17.78%；医药生物行业对全指医药贡献率为 88.44%；计算机行业对全指信息指数贡献居首，贡献率为 55.87%；计算机行业对中小 300 指数贡献居首，贡献率为 18.66%；计算机行业对深证 100 指数贡献最大，贡献率为 17.89%。

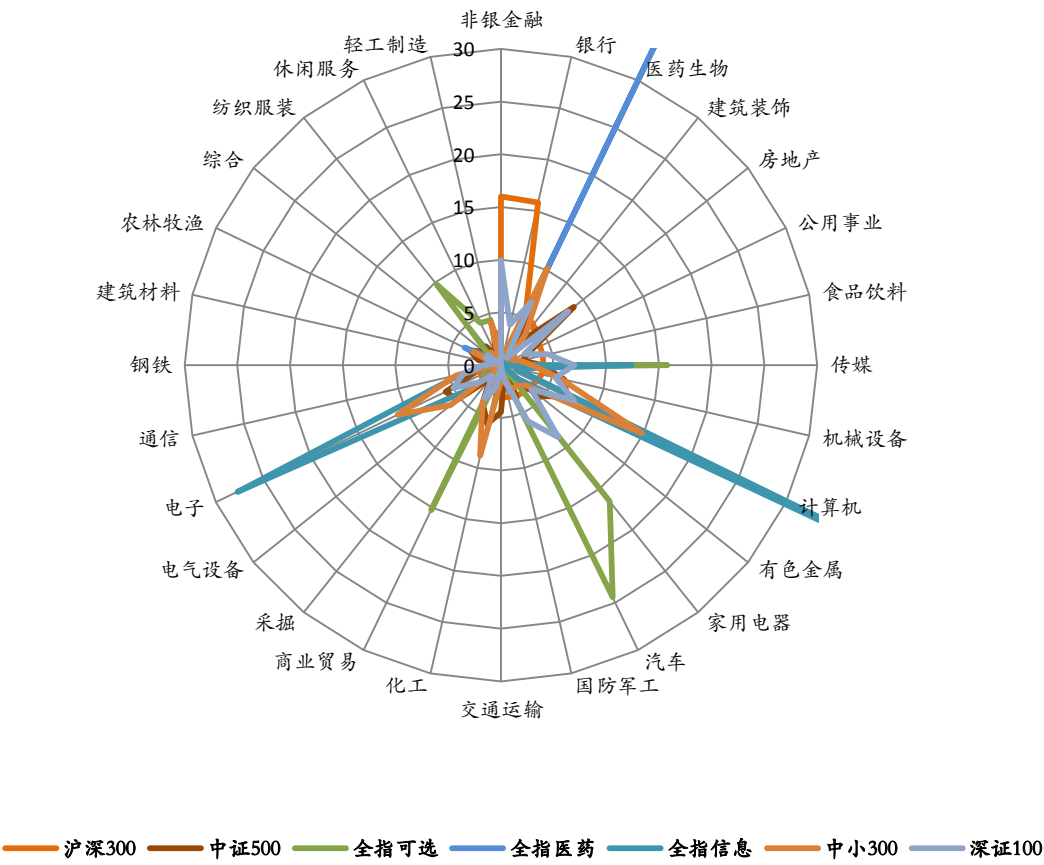
图 1 成份行业贡献率与月度涨跌幅



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 15.99%。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 9.45%、8.86%和 6.96%。汽车、家用电器、传媒在全指可选

指数中权重较大，分别为 24.43%、16.56%、15.8%。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 47.84%、27.73%和 12.40%。计算机、电子、医药生物在中小 300 指数中权重居前，分别为 14.86%、10.89%和 10.21%。非银金融、家用电器、房地产在深证 100 指数中权重位列前三，依次为 9.96%、8.73%和 8.16%。

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 1.18%。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 3.7% 以内，跟踪效果一般。

表 1 基金净值与跟踪误差

基金简称	2015 年 5 月		2015 年 4 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	2.1204	2.1204	1.813	1.813	1.2177	2009/11/26
广发沪深 300	2.141	2.431	2.08	2.37	3.6374	2008/12/30
广发中小板 300ETF	2.2464	2.041	1.781	1.6181	1.1839	2011/6/3
广发中小板 300 联接	1.9364	1.9364	1.5667	1.5667	1.5327	2011/6/9
广发深证 100 分级	1.5347	1.6226	1.4022	1.4901	1.6523	2012/5/7
广发中证 500ETF	2.8014	2.8014	2.3816	2.3816	0.6114	2013/4/11
广发全指可选消费 ETF	2.3174	2.3174	1.9842	1.9842	1.0027	2014/6/3
广发全指医药卫生 ETF	1.8192	1.8192	1.525	1.525	1.4076	2014/12/1
广发全指信息技术 ETF	2.0043	2.0043	1.5665	1.5665	1.4765	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

5 月沪深两市上涨，覆盖两市的申万 A 指上涨 14.11%。指数方面，本期核心市场指数中，中小板 300 涨幅居首，上涨 26.86%；上证 50 表现最差，下跌 4.28%。

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	3250.49	3250.13	3404.76	2996.72	3111.33	-4.28%	54144.14
上证 180	10608.55	10619.92	11441.07	9901.26	10535.54	-0.69%	97220.76
深证成指	14818.64	14846.48	17153.80	14027.60	16100.45	8.65%	18314.54
深证 100P	4988.90	5006.60	5819.63	4740.96	5443.59	9.11%	33399.90
中小板指	8777.18	8799.73	11733.49	8519.01	10972.11	25.01%	15905.64
中小板 300	1798.75	1804.95	2431.56	1738.80	2281.89	26.86%	30640.65
创业板指	2857.89	2868.10	3677.33	2753.87	3542.84	23.97%	11839.44
沪深 300	4749.89	4757.64	5226.84	4445.59	4840.83	1.91%	135975.87
中证 500	8469.67	8493.96	10637.91	7886.36	9966.85	17.68%	59592.87
申万 A 指	4625.87	4635.45	5640.98	4370.98	5278.39	14.11%	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	3120.85	3117.32	3412.08	2820.52	3097.18	-0.76%	7659.20
全指材料	4199.86	4210.31	5153.74	3903.46	4806.83	14.45%	33339.71
全指工业	6082.62	6095.53	7379.43	5550.11	6845.08	12.54%	70646.79
全指可选	7215.56	7235.22	8973.97	6839.05	8427.33	16.79%	34156.26
全指消费	9498.95	9511.69	11651.60	9052.81	10798.39	13.68%	13423.55
全指医药	11469.43	11491.45	14419.85	11013.00	13782.82	20.17%	11969.14
全指金融	7212.28	7220.20	7635.57	6756.91	6984.29	-3.16%	43225.93
全指信息	8393.92	8418.66	11220.43	8074.55	10761.63	28.21%	38660.98
全指电信	7032.62	7035.17	9411.31	6682.47	8896.61	26.50%	6886.07
全指公用	3836.29	3847.06	4575.60	3525.97	4171.04	8.73%	11502.62
中证全指	6258.61	6270.57	7528.69	5906.36	7047.31	12.60%	295753.63

图 3 核心指数月度表现

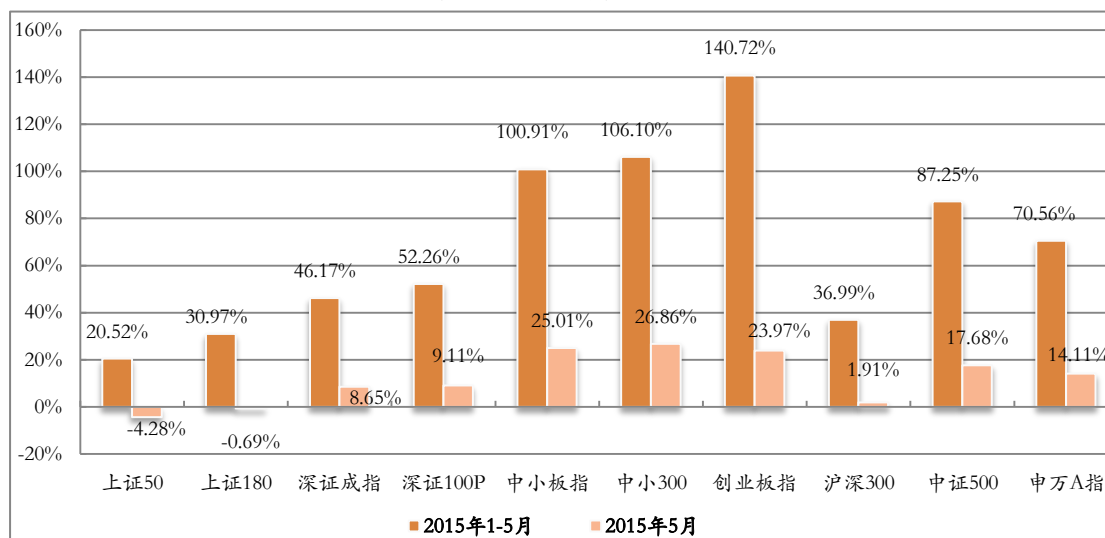


图 4 核心指数本月绝对收益

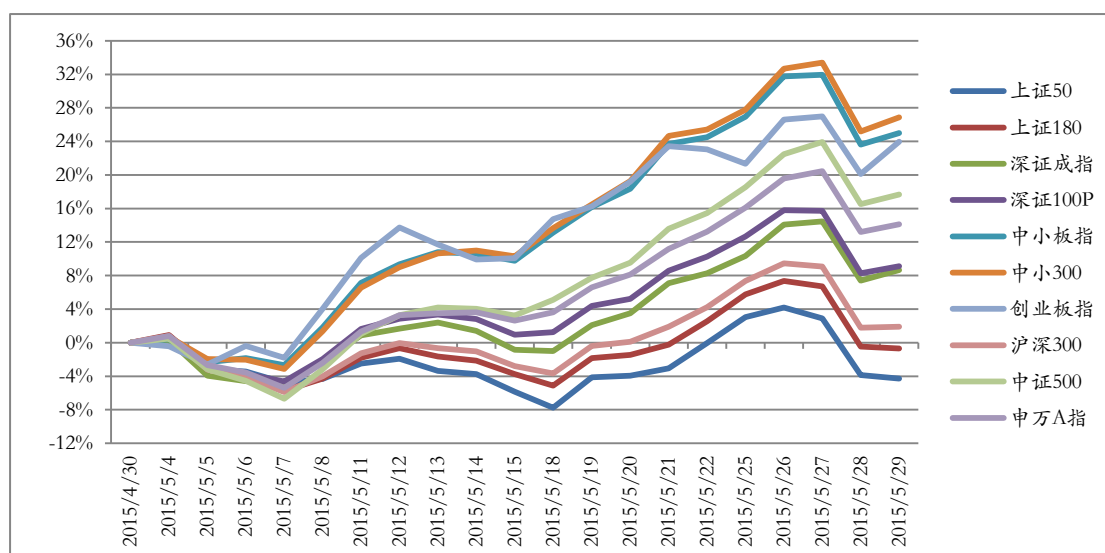
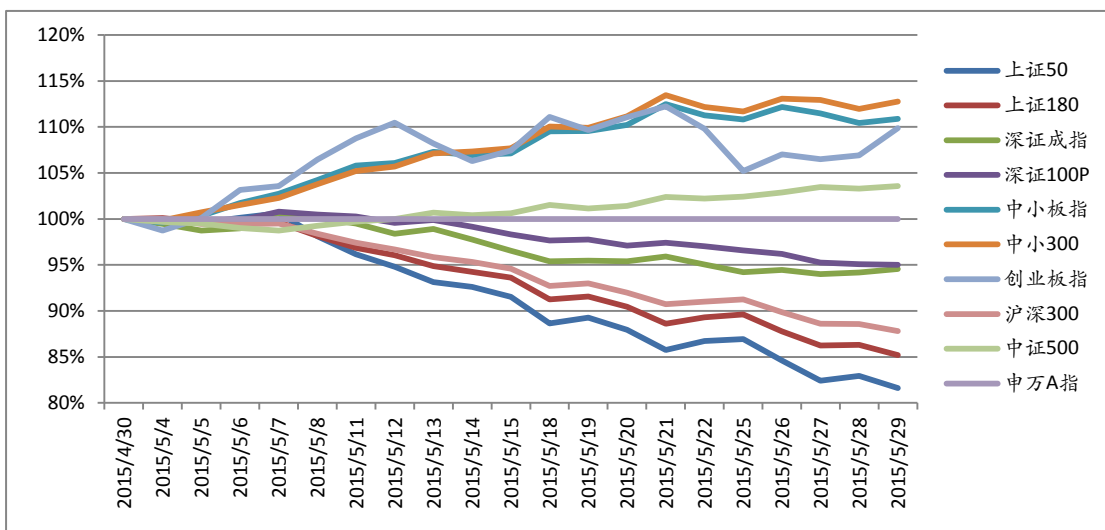


图 5 核心指数本月超额收益对比



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

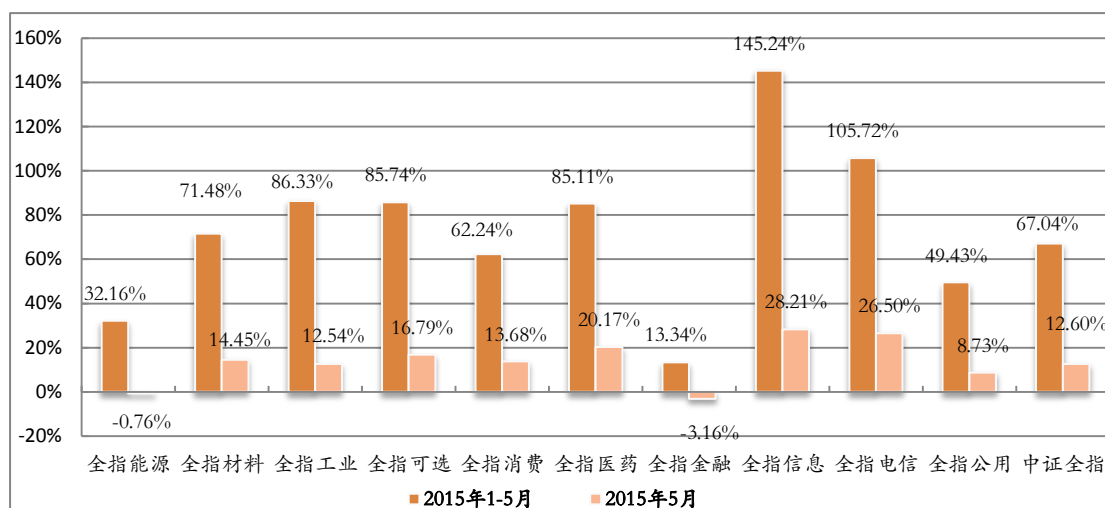


图 7 行业指数本月绝对收益

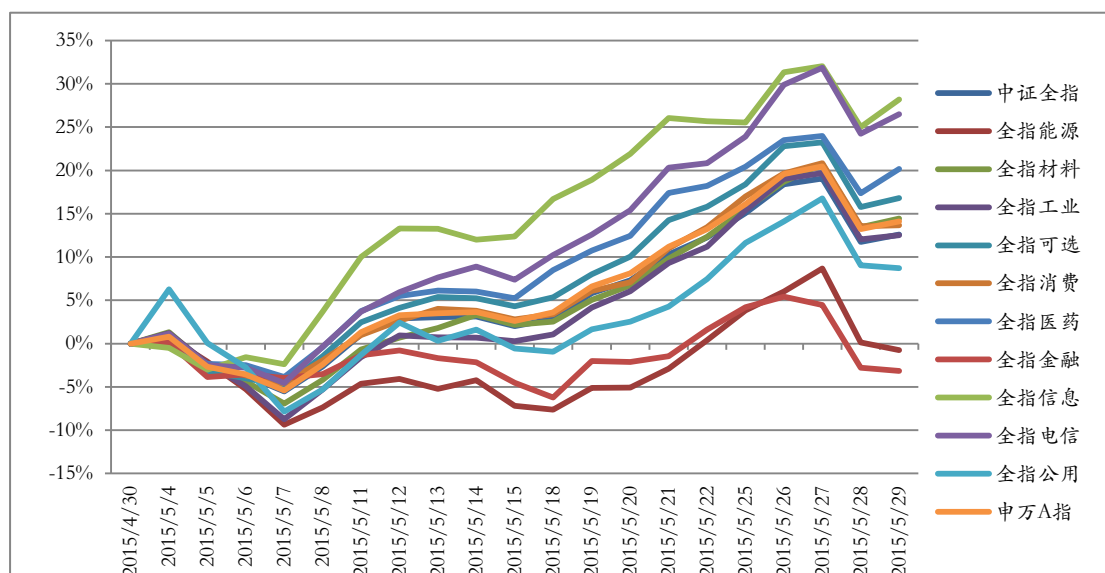
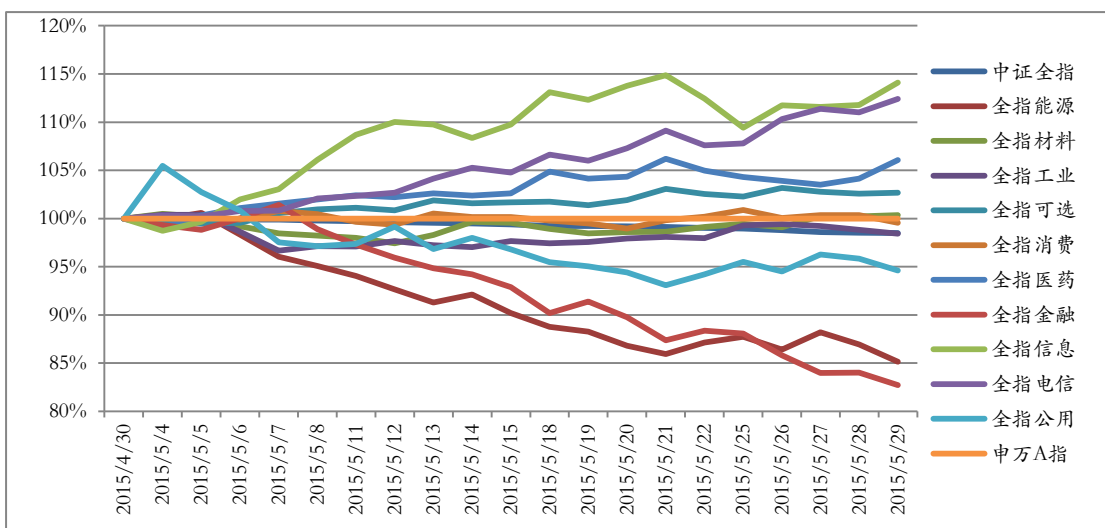


图 8 行业指数本月超额收益对比



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 5 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 21.4 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 12.4 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	12.97	13.03	12.36	1.77
上证 180	14.22	14.09	13.26	1.95
深证成指	48.16	45.32	34.73	5.12
深证 100P	32.99	31.01	25.31	4.00
中小板指数	58.78	56.09	43.58	7.05
中小板 300	69.77	65.88	46.63	7.04
创业板指 P	124.34	122.00	76.90	13.39
沪深 300	16.67	16.37	15.16	2.22
中证 500	62.24	59.51	42.56	5.05
申万 A 指	26.55	25.67	21.44	3.19

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	21.32	26.86	29.13	1.80
全指材料	59.49	57.16	41.30	3.70
全指工业	51.64	48.70	35.28	4.51
全指可选	38.30	36.76	27.40	4.67
全指消费	41.45	38.72	31.11	5.18
全指医药	67.53	63.59	46.30	7.55
全指金融	10.78	10.41	9.62	1.65
全指信息	121.53	114.09	72.66	10.21
全指电信	80.52	76.11	51.56	5.55
全指公用	25.10	23.49	20.52	3.07
中证全指	25.40	24.57	20.62	3.06

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	85.44	-3.63	70.55	9.17
600036	招商银行	18.07	-0.82	48.24	6.20
600016	民生银行	10.02	-5.65	41.00	5.64
601766	中国南车	29.45	-7.10	31.15	5.61
600030	中信证券	30.37	-11.61	92.15	4.97
贡献前 5 名样本股					
代码	简称	收盘	涨跌幅%	换手率%	贡献点数
601989	中国重工	17.67	21.36	247.04	14.82
600887	伊利股份	20.15	12.60	52.06	9.25
600703	三安光电	30.08	36.11	139.41	6.21
600196	复星医药	34.06	23.81	92.35	4.86
600519	贵州茅台	263.83	4.60	28.28	3.42
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
600703	三安光电	30.08	36.11	139.41	6.21
600196	复星医药	34.06	23.81	92.35	4.86
601989	中国重工	17.67	21.36	247.04	14.82
600332	白云山	42.12	17.00	104.71	2.12
600372	中航电子	43.38	16.14	172.95	2.08
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
600048	保利地产	12.08	-19.31	133.16	-12.19
600999	招商证券	30.32	-17.39	116.93	-9.72
601668	中国建筑	9.31	-14.59	213.67	-15.64
601006	大秦铁路	12.18	-12.81	71.54	-6.98
600030	中信证券	30.37	-11.61	92.15	-20.50

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	85.44	-3.63	70.55	5.40
600036	招商银行	18.07	-0.82	48.24	3.65
600016	民生银行	10.02	-5.65	41.00	3.32
601766	中国南车	29.45	-7.10	31.15	3.30
600030	中信证券	30.37	-11.61	92.15	2.92
贡献前 5 名样本股					
代码	简称	收盘	涨跌幅%	换手率%	贡献点数
601989	中国重工	17.67	21.36	247.04	29.42
600503	华丽家族	27.31	310.68	141.06	26.04
600271	航天信息	94.34	59.71	85.84	25.50
600118	中国卫星	73.48	53.19	247.81	19.61
600100	同方股份	28.78	40.94	147.55	19.36
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
600503	华丽家族	27.31	310.68	141.06	26.04
600435	北方导航	55.51	61.70	202.58	10.44
600522	中天科技	29.29	61.02	11.13	8.75
600271	航天信息	94.34	59.71	85.84	25.50
600373	中文传媒	32.98	59.25	134.81	8.36
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
601618	中国中冶	8.60	-22.03	273.63	-15.43
601669	中国电建	14.54	-20.46	322.49	-14.02
600048	保利地产	12.08	-19.31	133.16	-24.09
601186	中国铁建	20.76	-17.85	185.96	-18.01
600999	招商证券	30.32	-17.39	116.93	-19.25

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	62.21	9.14	73.87	2.03
000002	万科 A	14.35	-1.71	90.25	1.73
000001	平安银行	15.32	-8.26	67.45	1.37
000333	美的集团	37.00	0.08	38.43	1.08
002024	苏宁云商	18.53	41.82	264.85	1.07
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	18.53	41.82	264.85	210.71
002415	海康威视	45.36	38.50	110.87	95.19
300104	乐视网	67.82	13.24	204.08	85.01
002456	欧菲光	45.86	50.31	177.31	55.10
300070	碧水源	58.30	20.58	68.07	51.87
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
002456	欧菲光	45.86	50.31	177.31	55.10
002024	苏宁云商	18.53	41.82	264.85	210.71
002415	海康威视	45.36	38.50	110.87	95.19
002594	比亚迪	76.00	26.67	65.63	35.62
002241	歌尔声学	40.70	24.43	130.66	27.81
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	21.55	-14.48	95.48	-51.49
000402	金融街	12.65	-8.63	145.20	-19.26
000001	平安银行	15.32	-8.26	67.45	-65.16
000776	广发证券	25.83	-7.76	73.07	-18.96
000629	攀钢钒钛	4.94	-7.66	88.97	-13.25

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	62.21	9.14	73.87	4.66
000002	万科 A	14.35	-1.71	90.25	3.99
000001	平安银行	15.32	-8.26	67.45	3.16
000333	美的集团	37.00	0.08	38.43	2.48
002024	苏宁云商	18.53	41.82	264.85	2.46
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	18.53	41.82	264.85	39.57
300024	机器人	103.50	78.05	164.96	38.90
002415	海康威视	45.36	38.50	110.87	29.51
002405	四维图新	70.00	86.60	97.31	29.12
000917	电广传媒	42.89	49.44	147.29	28.13
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
002405	四维图新	70.00	86.60	97.31	29.12
300024	机器人	103.50	78.05	164.96	38.90
002456	欧菲光	45.86	50.31	177.31	16.68
000917	电广传媒	42.89	49.44	147.29	28.13
002024	苏宁云商	18.53	41.82	264.85	39.57
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	21.55	-14.48	95.48	-13.33
002146	荣盛发展	20.55	-12.81	149.59	-3.13
000009	中国宝安	20.22	-9.65	125.14	-4.93
000728	国元证券	33.00	-8.67	115.08	-5.72
000402	金融街	12.65	-8.63	145.20	-3.80

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	18.53	41.82	264.85	4.49
002415	海康威视	45.36	38.50	110.87	3.56
002450	康得新	42.29	35.33	72.11	2.89
002183	怡亚通	73.15	94.55	142.12	2.80
002230	科大讯飞	51.30	4.91	124.25	2.50
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	73.15	94.55	142.12	149.23
002024	苏宁云商	18.53	41.82	264.85	145.69
002415	海康威视	45.36	38.50	110.87	108.64
002405	四维图新	70.00	86.60	97.31	107.21
002450	康得新	42.29	35.33	72.11	82.99
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
002312	三泰控股	90.75	95.33	146.80	69.70
002183	怡亚通	73.15	94.55	142.12	149.23
002405	四维图新	70.00	86.60	97.31	107.21
002273	水晶光电	43.12	67.20	186.38	30.38
002104	恒宝股份	35.50	67.06	106.94	50.26
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
002146	荣盛发展	20.55	-12.81	149.59	-11.54
002051	中工国际	33.13	-6.25	184.08	-4.66
002155	湖南黄金	13.52	-4.65	134.26	-2.99
002142	宁波银行	18.89	-2.68	108.49	-4.21
002673	西部证券	62.74	-1.04	215.68	-1.80

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	18.53	41.82	264.85	2.46
002415	海康威视	45.36	38.50	110.87	1.95
002450	康得新	42.29	35.33	72.11	1.58
002183	怡亚通	73.15	94.55	142.12	1.53
002230	科大讯飞	51.30	4.91	124.25	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	73.15	94.55	142.12	17.00
002024	苏宁云商	18.53	41.82	264.85	16.61
002415	海康威视	45.36	38.50	110.87	12.38
002405	四维图新	70.00	86.60	97.31	12.22
002450	康得新	42.29	35.33	72.11	9.46
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
002131	利欧股份	74.01	160.69	76.29	5.22
002555	顺荣三七	55.39	153.70	127.07	4.22
002421	达实智能	32.40	140.62	147.62	4.73
002276	万马股份	36.70	106.53	198.78	6.50
002698	博实股份	70.38	105.31	85.17	3.05
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
002681	奋达科技	73.90	-19.06	220.37	-1.03
002146	荣盛发展	20.55	-12.81	149.59	-1.32
002051	中工国际	33.13	-6.25	184.08	-0.53
002155	湖南黄金	13.52	-4.65	134.26	-0.34
002204	大连重工	16.14	-4.61	183.01	-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	74.29	-11.51	167.73	6.25
300104	乐视网	67.82	13.24	204.08	4.06
300024	机器人	103.50	78.05	164.96	3.78
300168	万达信息	140.34	33.18	76.83	3.41
300027	华谊兄弟	42.14	20.43	165.99	2.59
贡献前 5 名样本股					
代码	简称	收盘	涨跌幅%	换手率%	贡献点数
300024	机器人	103.50	78.05	164.96	58.67
300168	万达信息	140.34	33.18	76.83	30.10
300085	银之杰	120.47	77.16	8.81	25.86
300001	特锐德	65.60	236.41	81.59	24.24
300010	立思辰	47.26	90.68	243.57	20.72
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
300001	特锐德	65.60	236.41	81.59	24.24
300271	华宇软件	64.77	124.82	87.63	20.42
300096	易联众	39.55	95.21	323.75	16.39
300010	立思辰	47.26	90.68	243.57	20.72
300024	机器人	103.50	78.05	164.96	58.67
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
300033	同花顺	94.88	-12.70	246.10	-6.88
300059	东方财富	74.29	-11.51	167.73	-28.80
300295	三六五网	153.86	-7.71	92.73	-1.66
300171	东富龙	74.00	-4.70	116.55	-1.10
300113	顺网科技	57.80	-4.30	6.16	-1.02

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	85.44	-3.63	70.55	3.76
600036	招商银行	18.07	-0.82	48.24	2.54
600016	民生银行	10.02	-5.65	41.00	2.31
601766	中国南车	29.45	-7.10	31.15	2.30
600030	中信证券	30.37	-11.61	92.15	2.04
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	18.53	41.82	264.85	10.09
300024	机器人	103.50	78.05	164.96	9.90
601989	中国重工	17.67	21.36	247.04	9.42
600271	航天信息	94.34	59.71	85.84	8.08
600118	中国卫星	73.48	53.19	247.81	6.31
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
000883	湖北能源	13.03	102.64	194.92	5.84
300024	机器人	103.50	78.05	164.96	9.90
600038	中直股份	80.84	62.20	184.59	2.28
600271	航天信息	94.34	59.71	85.84	8.08
600373	中文传媒	32.98	59.25	134.81	2.72
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
601618	中国中冶	8.60	-22.03	273.63	-4.93
000401	冀东水泥	16.30	-21.63	241.96	-1.02
601669	中国电建	14.54	-20.46	322.49	-4.51
600048	保利地产	12.08	-19.31	133.16	-7.71
601186	中国铁建	20.76	-17.85	185.96	-5.76

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	74.29	-11.51	167.73	1.68
300168	万达信息	140.34	33.18	76.83	0.91
002183	怡亚通	73.15	94.55	142.12	0.87
601099	太平洋	15.10	5.37	149.64	0.71
002405	四维图新	70.00	86.60	97.31	0.65
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	73.15	94.55	142.12	41.55
601608	中信重工	26.30	307.76	133.90	31.03
002405	四维图新	70.00	86.60	97.31	29.96
300168	万达信息	140.34	33.18	76.83	22.79
600820	隧道股份	21.77	53.20	188.03	22.59
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
601608	中信重工	26.30	307.76	133.90	31.03
002612	朗姿股份	82.30	120.23	76.01	5.06
002276	万马股份	36.70	106.53	198.78	17.00
002698	博实股份	70.38	105.31	85.17	8.10
000587	金叶珠宝	35.20	102.53	195.11	13.27
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
601000	唐山港	13.87	-19.41	321.72	-5.16
601519	大智慧	27.69	-17.29	324.20	-8.85
600528	中铁二局	21.11	-12.55	274.63	-4.23
601872	招商轮船	9.05	-11.88	191.37	-4.40
300059	东方财富	74.29	-11.51	167.73	-21.81

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	85.22	-3.88	67.48	1.69
600030	中信证券	30.73	-10.56	86.99	0.98
600016	民生银行	10.05	-5.37	39.24	0.90
601166	兴业银行	18.04	-4.34	75.07	0.88
600036	招商银行	17.92	-1.65	45.74	0.77
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	19.13	46.41	255.61	5.05
600503	华丽家族	29.91	349.77	121.96	4.80
601989	中国重工	17.26	18.54	233.55	4.69
600887	伊利股份	21.11	17.96	48.35	3.93
002183	怡亚通	66.50	76.86	134.15	3.87
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
300434	金石东方	136.33	511.89	23.19	0.42
300437	清水源	149.46	511.79	5.95	0.45
002751	易尚展示	135.18	511.67	10.37	0.43
300448	浩云科技	203.62	511.66	7.80	0.74
300404	博济医药	165.94	511.65	7.46	0.50
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
601618	中国中冶	8.86	-19.67	264.19	-1.86
000517	荣安地产	20.34	-19.06	322.03	-0.16
601669	中国电建	14.98	-18.05	312.46	-2.03
000401	冀东水泥	17.09	-17.84	230.64	-0.34
002681	奋达科技	75.06	-17.79	212.12	-0.26

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。