

广发基金指数月报

(2015年6月1日—2015年6月30日)

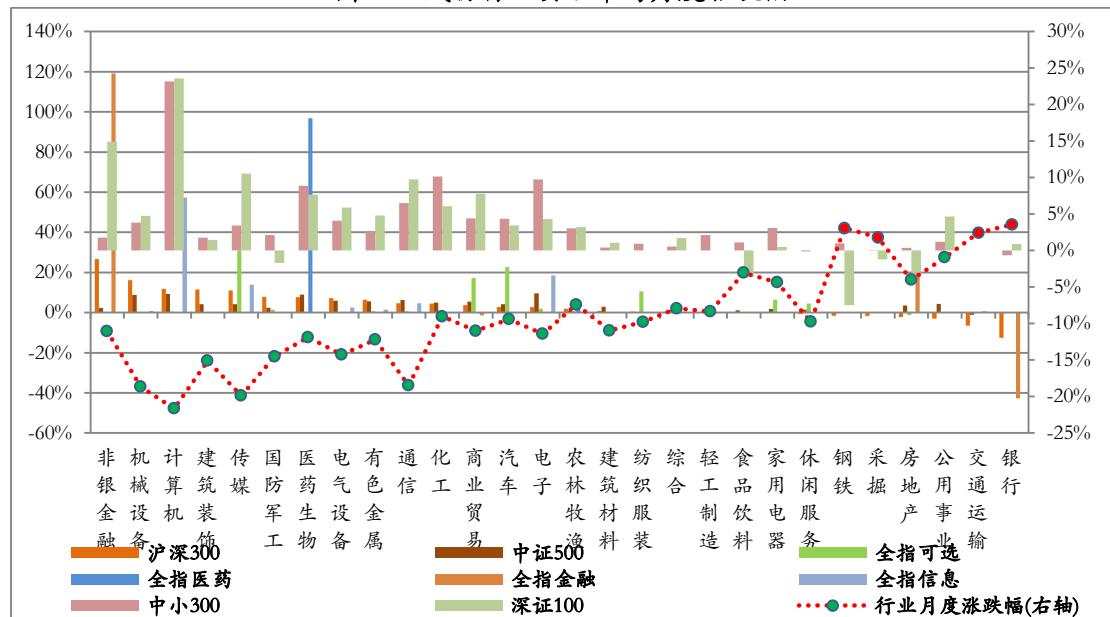
广发基金数量投资部

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

本月市场大幅下跌，申万28个一级行业跌多涨少，计算机行业跌幅居首，下跌21.63%。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26.6%；电子行业对中证500指数贡献最大，贡献率为9.56%；计算机行业对中小300指数贡献居首，贡献率为23.19%；计算机行业对深证100指数贡献最大，贡献率为23.58%。

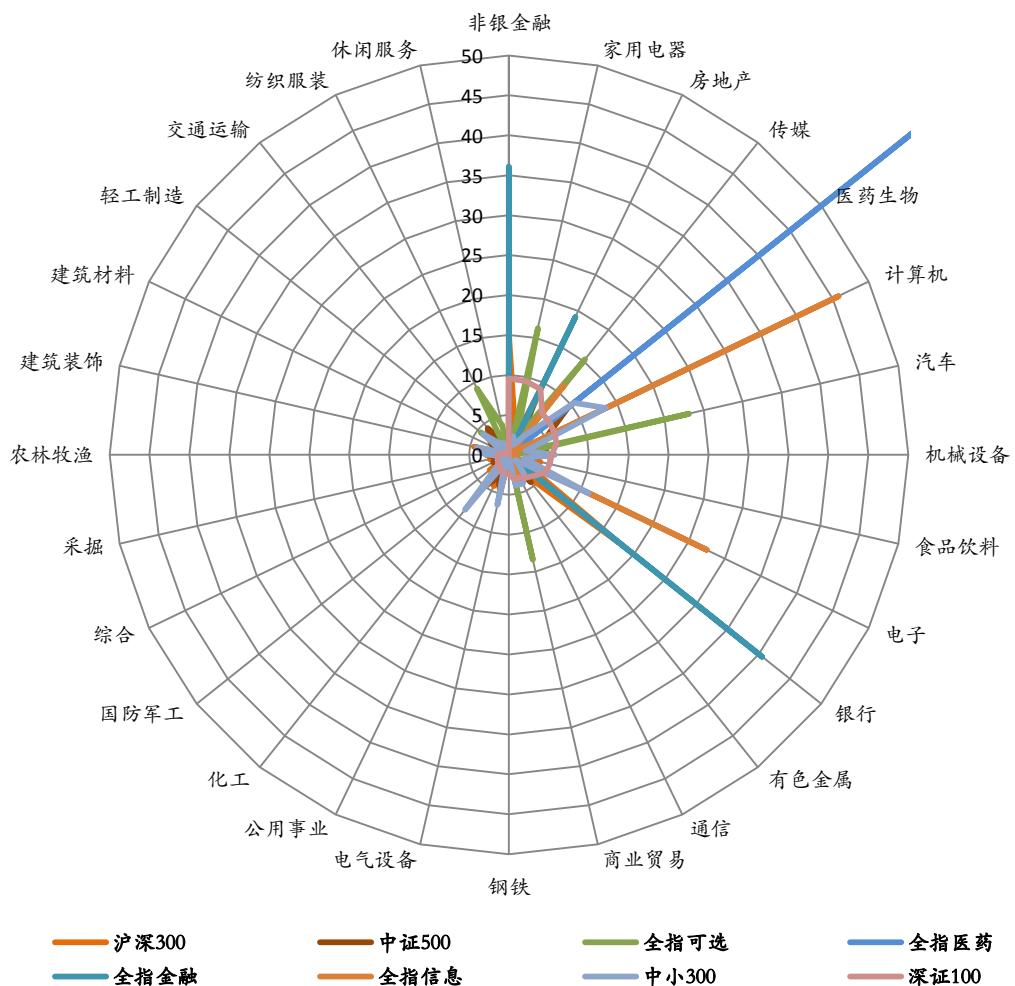
图1 成份行业贡献率与月度涨跌幅



以巨潮数据库提供的权重数据计算，本月末银行业在沪深300指数中所占权重居首，为17.57%。医药生物、房地产和化工行业在中证500指数中权重居前，依次为9.34%、8.19%和5.37%。汽车、家用电器、传媒在全指可选指数中权重较大，分别为23.1%、16.2%、15.3%。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45.8%、27.5%和11.1%。计算机、电子、医药生物在中小

300 指数中权重居前，分别为 13.46%、11.08% 和 10.42%。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 9.53%、9.45% 和 9.13%。

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 2.48%。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、广发全指信息技术 ETF 和广发全指金融地产 ETF 的年化跟踪误差均在 4.2% 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	1.8916	1.8916	2.1204	2.1204	1.8400	2009/11/26
广发沪深 300	1.9670	2.2570	2.141	2.431	3.5984	2008/12/30
广发中小板 300ETF	1.9092	1.7346	2.2464	2.041	2.4778	2011/6/3
广发中小板 300 联接	1.6428	1.6428	1.9364	1.9364	4.1128	2011/6/9
广发深证 100 分级	1.3988	1.4867	1.5347	1.6226	2.8805	2012/5/7
广发中证 500ETF	2.5006	2.5006	2.8014	2.8014	1.2351	2013/4/11
广发全指可选消费 ETF	2.0985	2.0985	2.3174	2.3174	1.6459	2014/6/3
广发全指医药卫生 ETF	1.5854	1.5854	1.8192	1.8192	1.6434	2014/12/1
广发全指信息技术 ETF	1.6000	1.6000	2.0043	2.0043	1.5424	2015/1/8
广发全指金融地产 ETF	0.9539	0.9539	0.9941	0.9941	1.4770	2015/3/23

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

6月沪深两市下跌，覆盖两市的申万A指下跌9.87%。指数方面，本期核心市场指数中，沪深300跌幅最小，下跌7.6%；创业板指表现最差，下跌19.3%。

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	3111.33	3114.79	3494.82	2530.83	2870.03	-7.76%	49133.36
上证 180	10535.54	10570.56	11815.51	8671.70	9723.85	-7.70%	99094.53
深证成指	16100.45	16247.39	18211.76	12723.16	14337.97	-10.95%	91750.96
深证 100P	5443.59	5476.73	6015.72	4459.15	5003.92	-8.08%	37560.84
中小板指	10972.11	11095.64	12084.30	8119.28	9232.48	-15.86%	18590.68
中小板 300	2281.89	2306.22	2570.67	1724.07	1948.80	-14.60%	37360.03
创业板指	3542.84	3580.08	4037.96	2485.46	2858.61	-19.31%	15237.30
沪深 300	4840.83	4862.76	5380.43	4000.93	4473.00	-7.60%	143544.95
中证 500	9966.85	10067.53	11616.38	7882.33	8906.02	-10.64%	74876.89
申万 A 指	5278.39	5317.89	5991.37	4251.20	4757.57	-9.87%	364610.53

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	3097.18	3113.47	3665.88	2856.92	3140.37	1.39%	10800.51
全指材料	4806.83	4852.82	5604.73	3883.27	4364.26	-9.21%	43568.39
全指工业	6845.08	6893.94	7683.71	5238.47	5964.42	-12.87%	80284.64
全指可选	8427.33	8488.03	9762.46	6849.74	7671.09	-8.97%	40346.98
全指消费	10798.39	10887.40	12429.94	9154.98	10157.10	-5.94%	17316.45
全指医药	13782.82	13978.44	15510.69	10737.19	12149.48	-11.85%	14274.50
全指金融	6984.29	6982.10	7964.49	5979.98	6737.85	-3.53%	53315.40
全指信息	10761.63	10870.14	12082.88	7650.12	8719.84	-18.97%	38689.01
全指电信	8896.61	9022.63	10356.18	6651.65	7576.74	-14.84%	7523.76
全指公用	4171.04	4226.74	4945.53	3757.26	4183.02	0.29%	14918.55
中证全指	7047.31	7098.98	8018.94	5693.21	6374.83	-9.54%	348663.36

图3 核心指数月度表现

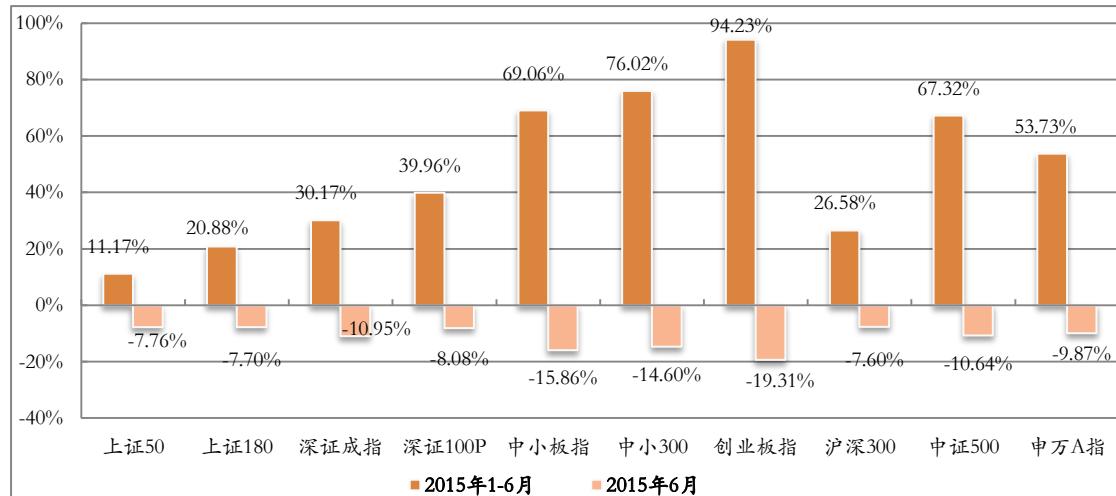


图4 核心指数本月绝对收益

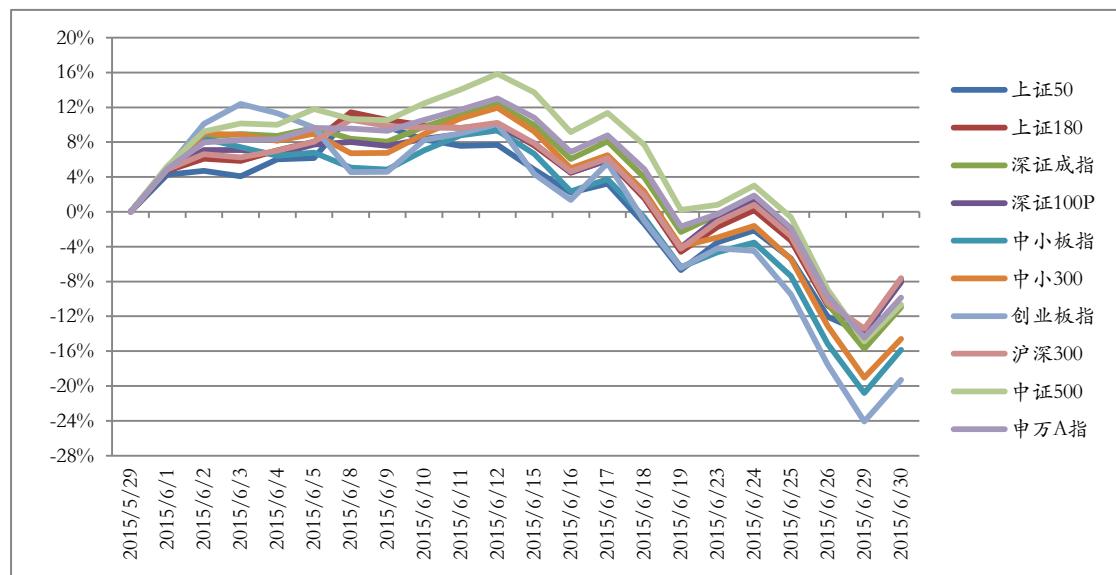
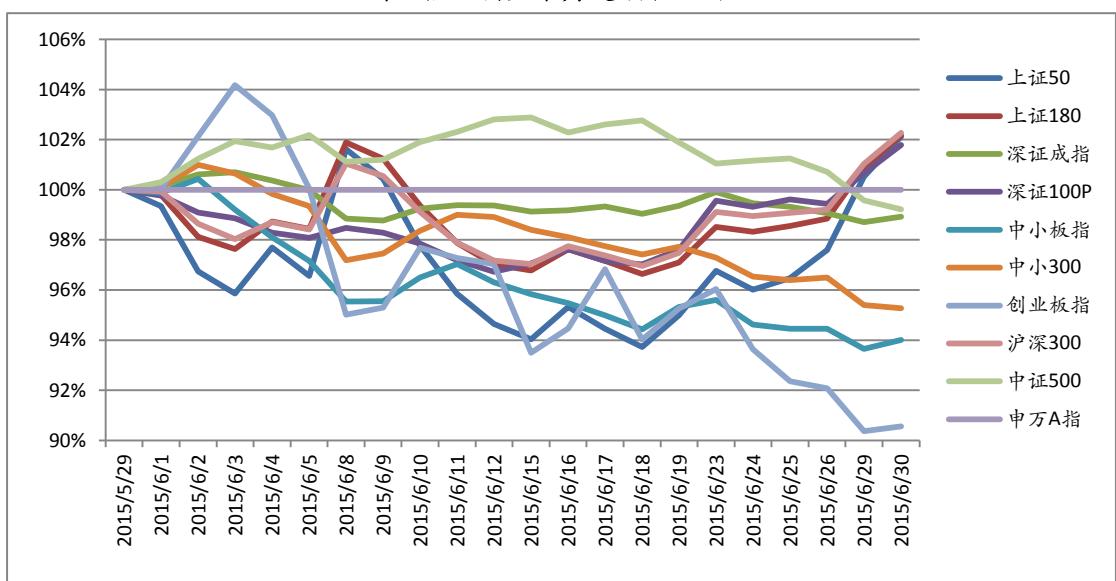


图5 核心指数本月超额收益对比



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

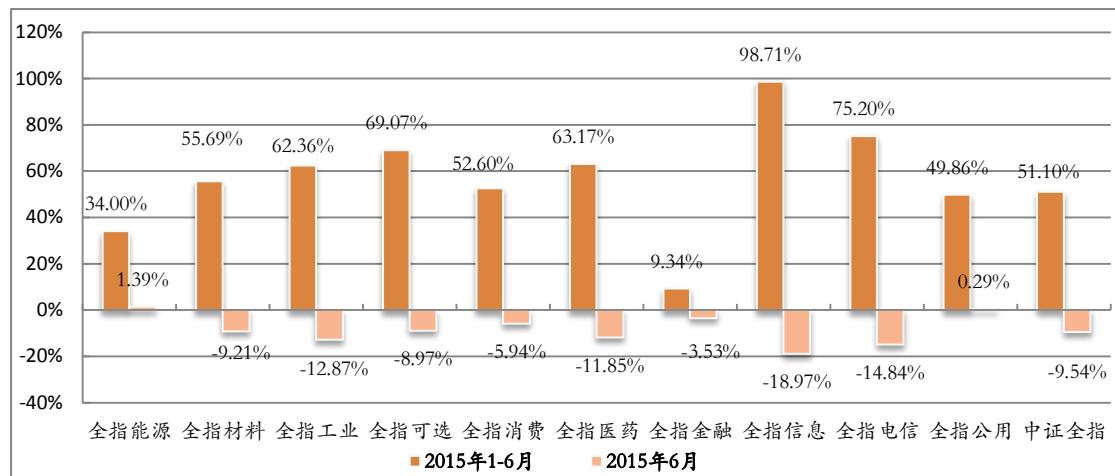


图 7 行业指数本月绝对收益

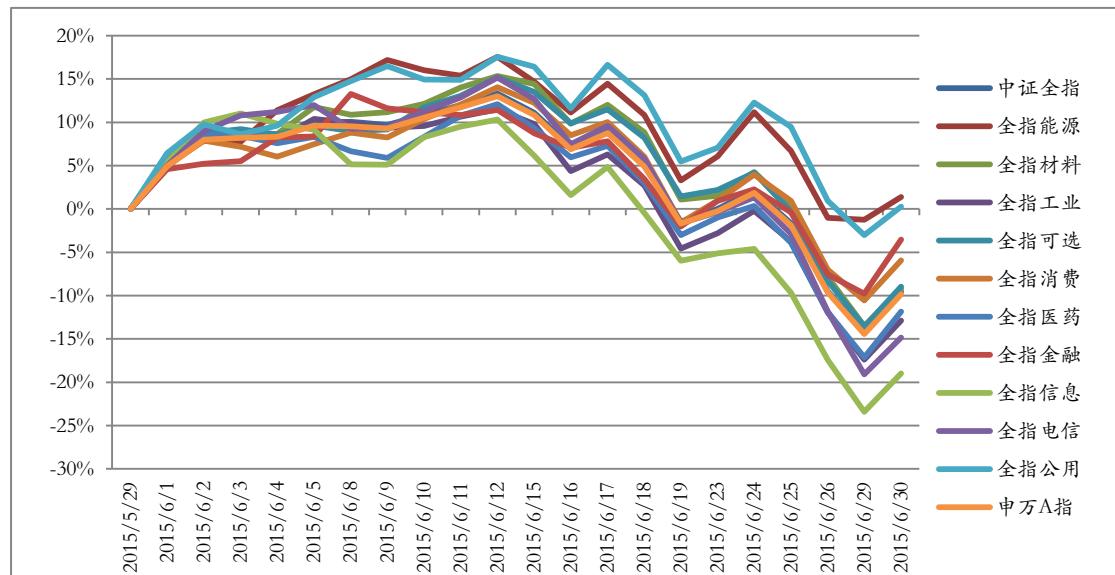
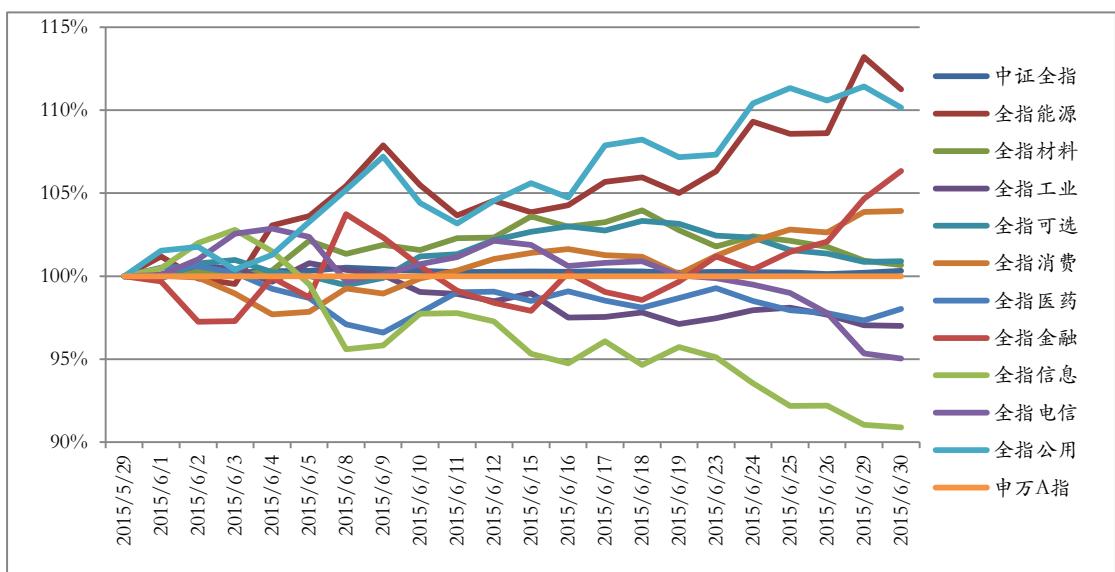


图 8 行业指数本月超额收益对比



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6月份核心指数的估值水平有所回落，市场平均动态（2015年）市盈率为19.96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11.69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	12.29	12.35	11.69	1.68
上证180	14.37	14.20	13.18	1.93
深证成指	44.24	41.34	31.53	4.74
深证100P	31.78	29.67	24.02	3.93
中小板指数	51.64	47.67	36.48	6.28
中小板300	61.52	56.71	40.37	6.31
创业板指P	97.61	94.77	61.34	10.68
沪深300	16.43	16.11	14.80	2.18
中证500	55.71	53.07	38.46	4.65
申万A指	24.71	23.89	19.96	2.96

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	20.93	26.29	28.24	1.79
全指材料	55.67	52.84	36.58	3.41
全指工业	46.52	43.78	32.08	4.01
全指可选	36.59	35.16	25.96	4.35
全指消费	39.97	36.95	30.03	4.99
全指医药	59.99	56.55	42.07	6.70
全指金融	11.20	10.75	9.94	1.70
全指信息	100.45	94.16	61.07	8.39
全指电信	67.12	63.36	43.90	4.65
全指公用	26.14	24.49	20.69	3.29
中证全指	24.12	23.31	19.50	2.90

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	81.94	-4.10	72.08	9.15
600036	招商银行	18.72	3.60	66.63	6.37
600016	民生银行	9.94	-0.80	68.15	6.05
600030	中信证券	26.91	-11.39	95.31	4.37
601166	兴业银行	17.25	-4.11	91.42	4.06
贡献前 5 名样本股					
代码	简称	收盘	涨跌幅%	换手率%	贡献点数
601328	交通银行	8.24	25.36	133.07	15.98
601006	大秦铁路	14.04	19.29	119.20	8.73
600036	招商银行	18.72	3.60	66.63	7.95
600016	民生银行	9.94	-0.80	68.15	6.97
601818	光大银行	5.36	7.22	131.07	5.63
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
600583	海油工程	16.66	27.91	272.70	4.27
601328	交通银行	8.24	25.36	133.07	15.98
601006	大秦铁路	14.04	19.29	119.20	8.73
601818	光大银行	5.36	7.22	131.07	5.63
601169	北京银行	13.32	4.64	100.13	0.95
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
601766	中国中车	18.36	-37.66	218.99	-63.13
600637	东方明珠	42.08	-36.70	83.62	-19.15
600893	中航动力	53.15	-24.38	124.35	-5.97
600406	国电南瑞	20.69	-22.97	132.95	-5.30
601688	华泰证券	23.13	-20.84	122.93	-12.03

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	81.94	-4.10	72.08	5.48
600036	招商银行	18.72	3.60	66.63	3.81
600016	民生银行	9.94	-0.80	68.15	3.62
600030	中信证券	26.91	-11.39	95.31	2.61
601166	兴业银行	17.25	-4.11	91.42	2.43
贡献前 5 名样本股					
代码	简称	收盘	涨跌幅%	换手率%	贡献点数
601328	交通银行	8.24	25.36	133.07	31.76
601006	大秦铁路	14.04	19.29	119.20	17.59
601988	中国银行	4.89	12.93	176.51	17.10
600886	国投电力	14.87	35.84	187.08	16.96
600011	华能国际	14.03	29.67	227.62	16.79
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
600376	首开股份	19.29	40.19	335.53	7.17
600886	国投电力	14.87	35.84	187.08	16.96
600027	华电国际	11.12	34.33	282.78	7.76
600649	城投控股	9.35	33.00	0.39	4.18
600011	华能国际	14.03	29.67	227.62	16.79
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
601766	中国中车	18.36	-37.66	218.99	-126.81
600637	东方明珠	42.08	-36.70	83.62	-38.95
600503	华丽家族	17.40	-36.29	264.84	-11.82
600271	航天信息	64.71	-31.41	97.60	-20.03
600718	东软集团	21.73	-29.40	143.78	-9.08

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	63.90	2.72	85.24	2.34
000002	万科 A	14.52	1.18	83.10	1.97
000001	平安银行	14.54	-5.09	81.79	1.46
000333	美的集团	37.28	0.76	48.86	1.22
300059	东方财富	63.09	-15.08	138.66	1.12
贡献前 5 名样本股					
代码	简称	收盘	涨跌幅%	换手率%	贡献点数
000778	新兴铸管	12.96	70.53	136.66	25.83
000858	五粮液	31.70	20.54	120.56	22.10
000709	河北钢铁	7.00	38.61	311.60	17.41
000031	中粮地产	18.89	69.37	424.86	16.81
000938	紫光股份	90.49	112.22	150.84	16.10
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
000506	中润资源	15.01	117.54	155.36	9.63
000938	紫光股份	90.49	112.22	150.84	16.10
002021	中捷资源	12.42	77.18	49.46	5.16
002476	宝莫股份	14.01	75.34	166.77	4.61
000778	新兴铸管	12.96	70.53	136.66	25.83
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
002093	国脉科技	16.00	-44.79	209.06	-11.05
300336	新文化	23.84	-41.37	144.68	-6.63
300077	国民技术	42.54	-39.65	103.75	-16.16
300367	东方网力	57.75	-39.15	61.56	-6.61
300134	大富科技	27.95	-38.97	113.28	-9.47

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	63.90	2.72	85.24	5.21
000002	万科 A	14.52	1.18	83.10	4.39
000001	平安银行	14.54	-5.09	81.79	3.26
000333	美的集团	37.28	0.76	48.86	2.72
000776	广发证券	22.65	-12.31	77.75	2.34
贡献前 5 名样本股					
代码	简称	收盘	涨跌幅%	换手率%	贡献点数
000778	新兴铸管	12.96	70.53	136.66	20.09
000858	五粮液	31.70	20.54	120.56	17.19
000709	河北钢铁	7.00	38.61	311.60	13.54
000728	国元证券	37.98	15.09	175.33	9.11
000568	泸州老窖	32.61	29.35	197.71	9.08
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
000778	新兴铸管	12.96	70.53	136.66	20.09
000709	河北钢铁	7.00	38.61	311.60	13.54
000568	泸州老窖	32.61	29.35	197.71	9.08
000039	中集集团	32.30	22.86	175.75	9.08
002146	荣盛发展	12.50	22.54	230.12	4.82
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
002405	四维图新	43.80	-37.43	30.06	-23.48
000977	浪潮信息	29.55	-32.99	110.02	-12.37
002065	东华软件	28.75	-32.79	113.89	-19.62
002230	科大讯飞	34.94	-31.89	123.76	-23.76
300315	掌趣科技	13.55	-30.55	182.37	-9.37

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	15.30	-17.43	196.67	4.41
002415	海康威视	44.80	-1.23	110.03	4.18
002183	怡亚通	73.15	0.00	0.00	3.33
002450	康得新	30.60	-27.64	93.26	2.49
002202	金风科技	19.47	-15.35	144.55	2.16
贡献前 5 名样本股					
代码	简称	收盘	涨跌幅%	换手率%	贡献点数
002223	鱼跃医疗	67.20	28.15	82.32	25.47
002142	宁波银行	21.15	11.96	152.85	18.28
002146	荣盛发展	12.50	22.54	230.12	17.73
002375	亚厦股份	29.21	10.80	58.34	9.63
002073	软控股份	23.10	11.38	209.28	9.54
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
002223	鱼跃医疗	67.20	28.15	82.32	25.47
002146	荣盛发展	12.50	22.54	230.12	17.73
002299	圣农发展	20.30	18.02	131.58	8.32
002142	宁波银行	21.15	11.96	152.85	18.28
002073	软控股份	23.10	11.38	209.28	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
002229	鸿博股份	23.88	-37.62	167.49	-16.27
002405	四维图新	43.80	-37.43	30.06	-86.42
002424	贵州百灵	62.56	-35.41	70.61	-26.62
002063	远光软件	31.27	-34.92	140.64	-36.40
002048	宁波华翔	20.79	-34.81	106.17	-28.71

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	15.30	-17.43	196.67	2.38
002415	海康威视	44.80	-1.23	110.03	2.25
002183	怡亚通	73.15	0.00	0.00	1.79
002450	康得新	30.60	-27.64	93.26	1.34
002202	金风科技	19.47	-15.35	144.55	1.16
贡献前 5 名样本股					
代码	简称	收盘	涨跌幅%	换手率%	贡献点数
002223	鱼跃医疗	67.20	28.15	82.32	2.90
002018	华信国际	44.08	20.14	46.43	2.61
002308	威创股份	31.00	35.43	74.64	2.43
002142	宁波银行	21.15	11.96	152.85	2.08
002146	荣盛发展	12.50	22.54	230.12	2.02
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
002010	传化股份	16.08	77.29	1.48	1.53
002021	中捷资源	12.42	77.18	49.46	1.68
002476	宝莫股份	14.01	75.34	166.77	1.50
002194	武汉凡谷	26.98	48.40	168.47	1.06
002601	佰利联	45.50	36.11	69.32	0.95
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
002093	国脉科技	16.00	-44.79	209.06	-3.60
002215	诺普信	17.25	-40.56	78.89	-3.71
002322	理工监测	21.85	-40.15	118.13	-1.81
002283	天润曲轴	17.05	-38.38	120.20	-2.36
002421	达实智能	20.03	-38.18	139.97	-3.08

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	63.09	-15.08	138.66	6.57
300104	乐视网	51.76	-23.68	152.17	3.84
300024	机器人	77.26	-25.32	155.09	3.49
300168	万达信息	49.12	-29.95	66.35	2.96
300027	华谊兄弟	38.14	-9.49	171.50	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
300101	振芯科技	55.60	54.40	97.81	9.23
300142	沃森生物	48.70	40.35	52.30	7.85
300079	数码视讯	27.79	14.77	164.42	5.57
300068	南都电源	20.85	20.52	118.69	3.73
300047	天源迪科	35.88	21.01	15.29	3.72
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
300101	振芯科技	55.60	54.40	97.81	9.23
300142	沃森生物	48.70	40.35	52.30	7.85
300047	天源迪科	35.88	21.01	15.29	3.72
300068	南都电源	20.85	20.52	118.69	3.73
300079	数码视讯	27.79	14.77	164.42	5.57
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
300336	新文化	23.84	-41.37	144.68	-7.78
300085	银之杰	71.73	-40.46	95.00	-24.01
300010	立思辰	28.52	-39.65	150.19	-17.26
300077	国民技术	42.54	-39.65	103.75	-18.96
300075	数字政通	37.69	-39.53	118.39	-14.54

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	81.94	-4.10	72.08	3.83
600036	招商银行	18.72	3.60	66.63	2.67
600016	民生银行	9.94	-0.80	68.15	2.53
600030	中信证券	26.91	-11.39	95.31	1.83
601166	兴业银行	17.25	-4.11	91.42	1.70
贡献前 5 名样本股					
代码	简称	收盘	涨跌幅%	换手率%	贡献点数
601328	交通银行	8.24	25.36	133.07	10.17
600029	南方航空	14.54	46.28	222.82	6.49
601006	大秦铁路	14.04	19.29	119.20	5.61
600886	国投电力	14.87	35.84	187.08	5.45
601988	中国银行	4.89	12.93	176.51	5.45
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
000778	新兴铸管	12.96	70.53	136.66	4.84
600029	南方航空	14.54	46.28	222.82	6.49
600115	东方航空	12.32	40.16	300.87	3.90
000709	河北钢铁	7.00	38.61	311.60	3.28
601898	中煤能源	11.42	38.59	356.72	2.35
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
601766	中国中车	18.36	-37.66	218.99	-40.61
600637	东方明珠	42.08	-36.70	83.62	-12.49
000883	湖北能源	8.72	-32.82	228.92	-3.55
002065	东华软件	28.75	-32.79	113.89	-4.20
002230	科大讯飞	34.94	-31.89	123.76	-5.41

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%
002183	怡亚通	73.15	0.00	0.00	0.94
600410	华胜天成	47.84	0.00	0.00	0.63
600978	宜华木业	22.44	25.36	94.42	0.55
002405	四维图新	43.80	-37.43	30.06	0.50
600881	亚泰集团	12.71	-15.94	152.69	0.48
贡献前 5 名样本股					
代码	简称	收盘	涨跌幅%	换手率%	贡献点数
600797	浙大网新	18.89	107.58	179.64	15.61
601718	际华集团	15.12	48.38	148.54	14.47
000031	中粮地产	18.89	69.37	424.86	13.31
600737	中粮屯河	20.81	41.37	351.72	11.89
600376	首开股份	19.29	40.19	335.53	10.59
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
600797	浙大网新	18.89	107.58	179.64	15.61
000031	中粮地产	18.89	69.37	424.86	13.31
600086	东方金钰	53.77	62.94	54.75	8.55
002194	武汉凡谷	26.98	48.40	168.47	3.63
601718	际华集团	15.12	48.38	148.54	14.47
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
002093	国脉科技	16.00	-44.79	209.06	-10.50
600536	中国软件	35.48	-42.67	178.83	-14.18
600704	物产中大	23.88	-40.41	131.83	-17.93
600112	天成控股	19.00	-40.10	156.34	-9.54
300134	大富科技	27.95	-38.97	113.28	-8.67

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	81.94	-4.10	68.40	1.75
600016	民生银行	9.94	-0.80	65.94	0.95
600030	中信证券	26.91	-11.39	89.78	0.93
601166	兴业银行	17.25	-4.11	87.70	0.90
600036	招商银行	18.72	3.60	63.98	0.86
贡献前 5 名样本股					
代码	简称	收盘	涨跌幅%	换手率%	贡献点数
601985	中国核电	13.07	167.83	118.54	4.87
601328	交通银行	8.24	25.36	125.48	3.67
600029	南方航空	14.54	46.28	215.73	2.55
600886	国投电力	14.87	35.84	180.53	2.37
000778	新兴铸管	12.96	70.53	129.40	2.09
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
300465	高伟达	91.30	412.06	108.67	0.48
300467	迅游科技	297.30	405.53	8.74	0.48
603598	引力传媒	56.07	346.77	283.48	0.29
603918	金桥信息	55.60	269.44	140.55	0.17
603885	吉祥航空	68.96	254.00	170.09	0.66
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
300434	金石东方	59.27	-60.48	333.13	-0.27
300447	全信股份	83.00	-60.29	152.94	-0.45
300449	汉邦高科	99.70	-60.01	299.28	-0.47
300438	鹏辉能源	69.10	-59.82	303.99	-0.38
002752	昇兴股份	33.44	-58.56	380.63	-0.50

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:

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

- 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。

- 行业贡献率=行业涨跌幅×权重/指数涨跌幅

- 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。