

广发基金指数月报

(2015年8月3日-2015年8月31日)

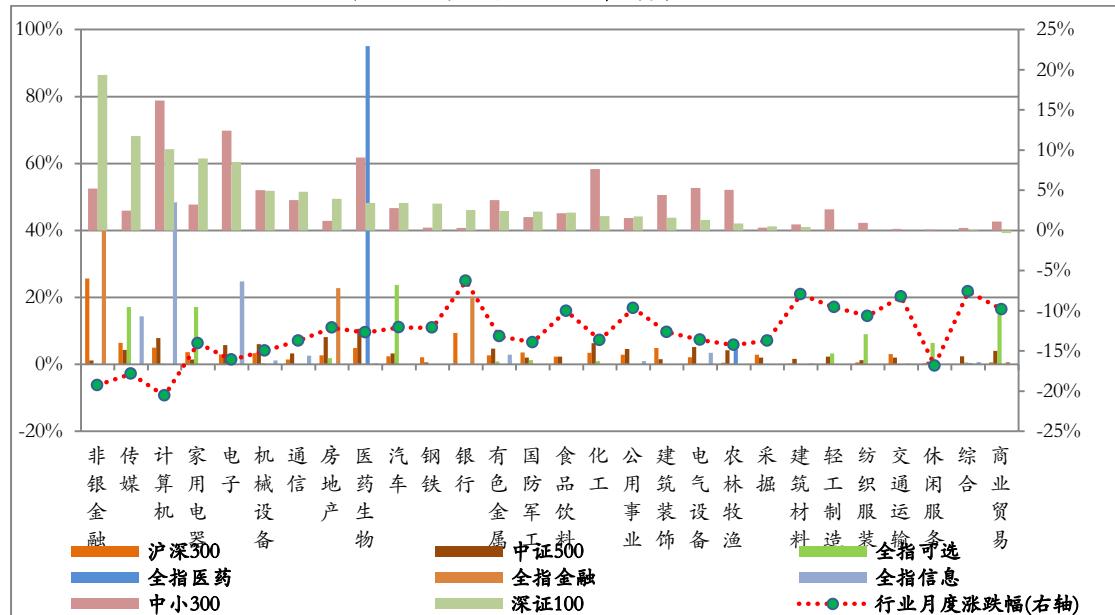
广发基金数量投资部

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

本月市场依然下跌，申万28个一级行业全部下跌，计算机行业跌幅居首，下跌20.55%。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25.6%；医药生物行业对中证500指数贡献最大，贡献率为10.61%；计算机行业对中小300指数贡献居首，贡献率为16.19%；非银金融行业对深证100指数贡献最大，贡献率为19.37%。

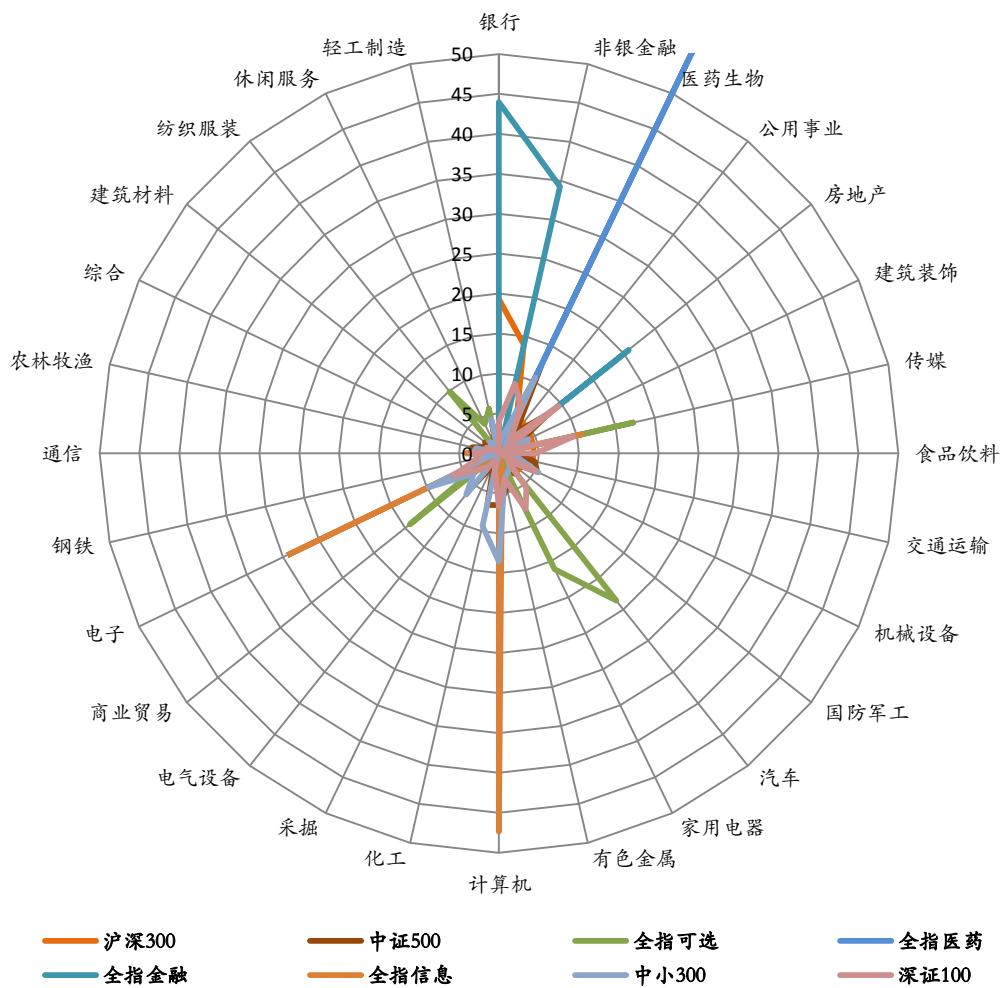
图1 成份行业贡献率与月度涨跌幅



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19.33%。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12.03%、7.88%和6.62%。汽车、传媒、家用电器在全指可选指数中权重较大，分别为23.6%、17.3%、16.1%。计算机、医药生物和电子在中小300指数中权重居前，分别为13.54%、10.53%和9.77%。传媒、房地产和非银金融在深

证 100 指数中权重位列前三，依次为 9.61%、9.55% 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 4.83%。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 的年化跟踪误差最高达 5.84%。

表 1 基金净值与跟踪误差

基金简称	2015 年 8 月		2015 年 7 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	1.3827	1.3827	1.6020	1.6020	1.8885	2009/11/26

广发沪深 300	1.4720	1.7620	1.6860	1.9760	5.8445	2008/12/30
广发中小板 300ETF	1.3777	1.2517	1.6344	1.4849	4.8296	2011/6/3
广发中小板 300 联接	1.1538	1.1538	1.3511	1.3511	3.2736	2011/6/9
广发深证 100 分级	0.9803	1.0682	1.1507	1.2386	10.5530	2012/5/7
广发中证 500ETF	1.8209	1.8209	2.1235	2.1235	2.3313	2013/4/11
广发全指可选消费 ETF	1.5588	1.5588	1.7672	1.7672	3.5827	2014/6/3
广发全指医药卫生 ETF	1.2237	1.2237	1.4074	1.4074	1.7644	2014/12/1
广发全指信息技术 ETF	1.0590	1.0590	1.3113	1.3113	1.5874	2015/1/8
广发全指金融地产 ETF	0.7146	0.7146	0.8127	0.8127	0.9837	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

8月沪深两市下跌，覆盖两市的申万 A 指下跌 13.16%。指数方面，本期核心市场指数中，上证 50 跌幅最小，下跌 10.19%；创业板指表现最差，下跌 21.38%。

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	2461.24	2433.24	2626.36	1874.22	2210.45	-10.19%	21101.63
上证 180	8282.52	8175.01	8899.43	6360.08	7334.36	-11.45%	45818.87
深证成指	12374.25	12178.57	13652.54	9713.99	10549.16	-14.75%	50883.68
深证 100P	4287.72	4225.05	4647.27	3374.70	3697.98	-13.75%	17987.73
中小板指	8336.12	8228.27	9152.49	6570.39	7133.33	-14.43%	11430.26
中小板 300	1716.18	1691.21	1903.65	1351.82	1459.65	-14.95%	23105.33
创业板指	2539.84	2475.33	2747.83	1843.19	1996.87	-21.38%	9398.72
沪深 300	3816.70	3766.07	4113.16	2952.01	3366.54	-11.79%	65429.93
中证 500	7727.06	7605.89	8858.33	6099.17	6581.31	-14.83%	41464.93
申万 A 指	4016.46	3957.84	4470.87	3179.84	3488.00	-13.16%	204617.88

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	2493.61	2461.34	2823.78	1873.81	2116.82	-15.11%	4783.68

全指材料	3560.88	3516.97	4120.88	2867.51	3117.06	-12.46%	23423.73
全指工业	5049.62	4969.29	5755.46	3952.77	4431.97	-12.23%	45071.14
全指可选	6541.79	6449.77	7420.60	5315.99	5767.15	-11.84%	24954.73
全指消费	8888.60	8774.39	9807.33	7303.41	7910.49	-11.00%	9812.33
全指医药	10734.05	10593.17	11860.30	8536.80	9321.50	-13.16%	8634.94
全指金融	5703.94	5637.71	6010.60	4382.59	5014.33	-12.09%	22767.12
全指信息	7285.47	7120.94	8063.12	5367.32	5828.86	-19.99%	25058.32
全指电信	6599.05	6498.33	7363.50	4965.28	5532.69	-16.16%	4220.75
全指公用	3456.91	3417.86	4050.03	2867.95	3178.14	-8.06%	7099.11
中证全指	5380.01	5302.48	5984.87	4257.86	4684.96	-12.92%	192205.05

图3 核心指数月度表现

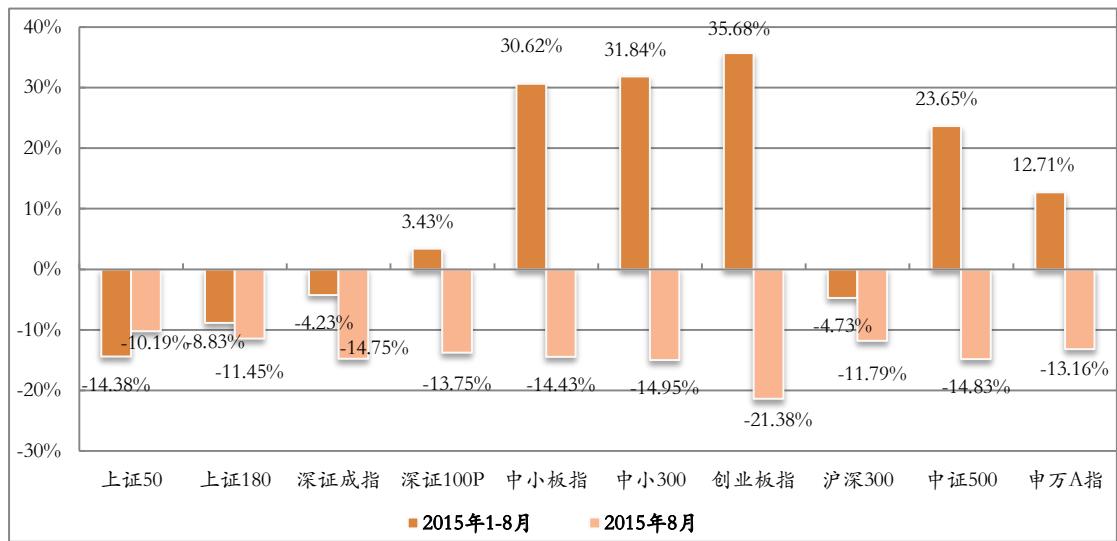


图4 核心指数本月绝对收益

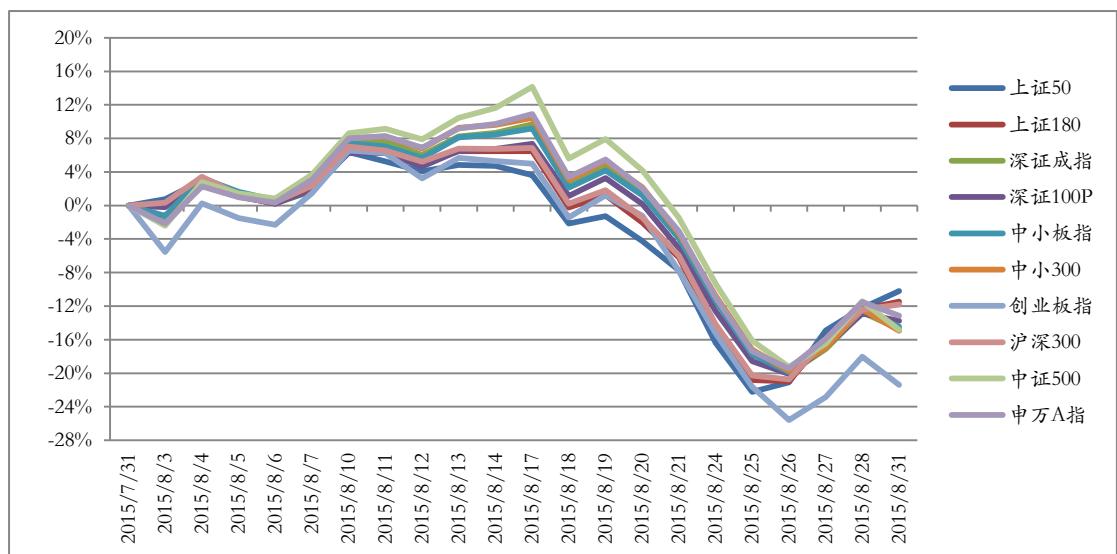
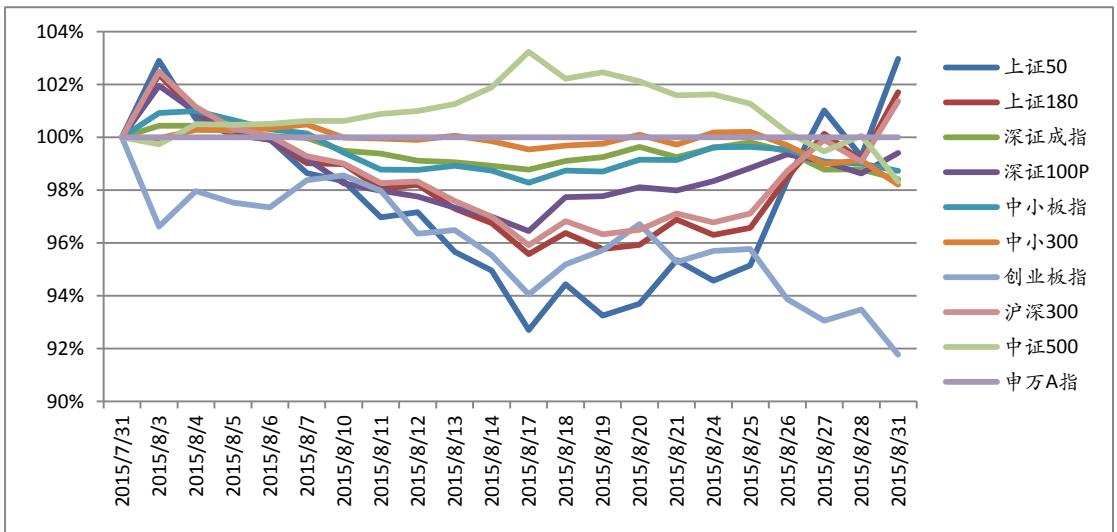


图5 核心指数本月超额收益对比



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

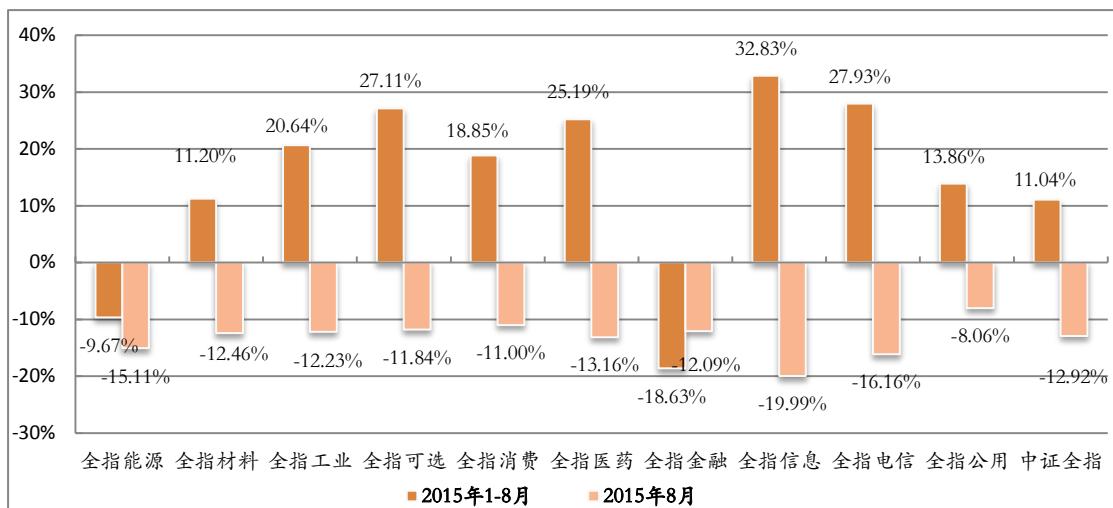


图 7 行业指数本月绝对收益

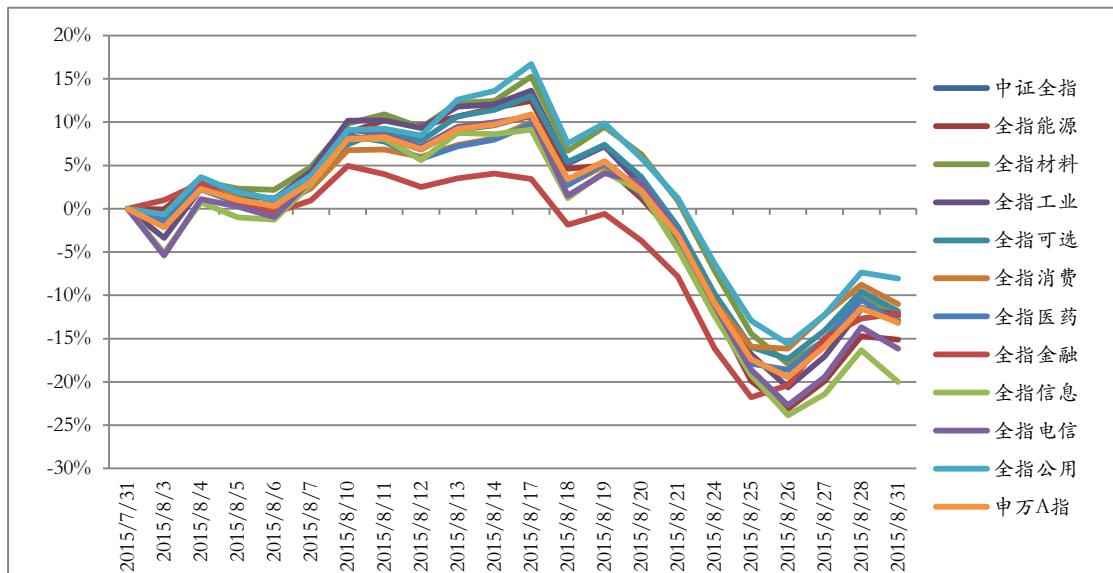
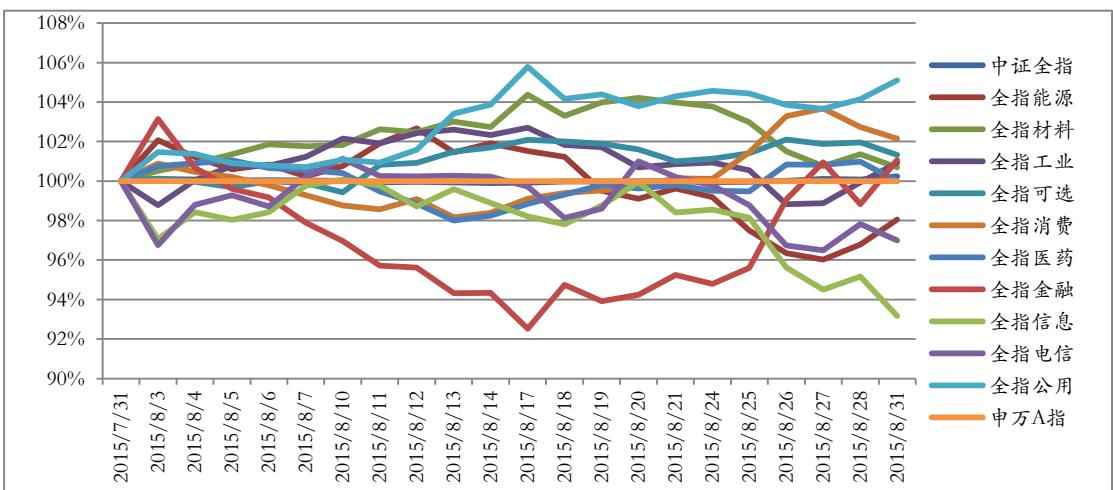


图 8 行业指数本月超额收益对比



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 8 月份核心指数的估值水平小幅下降，市场平均动态（2016 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 9.16 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	16.12	9.32	9.16	1.13
上证 180	17.97	10.40	10.13	1.26
深证成指	50.96	27.52	23.40	2.97
深证 100	35.11	19.33	17.39	2.44
中小板指	58.02	32.49	27.60	4.25
中小 300	70.33	38.36	30.95	4.22
创业板指	117.76	60.82	43.40	6.80
沪深 300	20.25	11.70	11.28	1.41
中证 500	69.50	37.44	29.61	2.94
申万 A 指	29.42	16.85	15.05	1.90

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	41.54	20.86	21.34	1.07
全指材料	77.97	37.10	30.48	2.15
全指工业	58.06	30.51	25.11	2.52
全指可选	45.65	25.20	20.36	2.89
全指消费	47.62	28.35	24.18	3.48
全指医药	70.73	40.76	33.62	4.50
全指金融	12.84	7.71	7.42	1.14
全指信息	113.88	57.50	41.56	4.97
全指电信	94.10	46.95	34.92	1.92
全指公用	31.24	17.67	14.98	1.90
中证全指	28.85	16.51	14.76	1.86

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	30.29	-9.23	47.80	8.80
600036	招商银行	17.05	-1.45	27.03	7.55
600016	民生银行	8.57	-5.72	17.94	6.79
600000	浦发银行	14.96	-0.73	31.51	4.49
601166	兴业银行	14.58	-6.18	47.05	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
601169	北京银行	9.40	7.06	45.45	3.76
600050	中国联通	6.55	5.81	121.54	1.80
600018	上港集团	7.84	9.19	119.82	1.00
600585	海螺水泥	18.28	-2.04	66.43	-0.44
601006	大秦铁路	10.07	-1.47	41.26	-0.51
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
600018	上港集团	7.84	9.19	119.82	1.00
601169	北京银行	9.40	7.06	45.45	3.76
600050	中国联通	6.55	5.81	121.54	1.80
600000	浦发银行	14.96	-0.73	31.51	-0.73
600036	招商银行	17.05	-1.45	27.03	-2.45
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
600958	东方证券	16.61	-30.74	76.59	-4.61
600837	海通证券	12.15	-29.36	71.62	-24.23
600030	中信证券	15.07	-26.59	79.49	-25.35
600999	招商证券	15.96	-25.35	81.99	-7.46
601688	华泰证券	14.59	-24.64	63.02	-9.29

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	30.29	-9.23	47.80	5.37
600036	招商银行	17.05	-1.45	27.03	4.61
600016	民生银行	8.57	-5.72	17.94	4.15
600000	浦发银行	14.96	-0.73	31.51	2.74
601166	兴业银行	14.58	-6.18	47.05	2.73
贡献前 5 名样本股					
代码	简称	收盘	涨跌幅%	换手率%	贡献点数
601169	北京银行	9.40	7.06	45.45	7.47
601919	中国远洋	11.63	14.92	46.52	5.54
601618	中国中冶	7.79	12.25	120.85	4.97
600050	中国联通	6.55	5.81	121.54	3.56
600018	上港集团	7.84	9.19	119.82	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
600639	浦东金桥	20.90	15.73	238.86	1.10
601919	中国远洋	11.63	14.92	46.52	5.54
601618	中国中冶	7.79	12.25	120.85	4.97
600018	上港集团	7.84	9.19	119.82	2.02
600633	浙报传媒	18.02	7.52	25.09	0.94
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
600376	首开股份	10.66	-41.91	200.84	-10.33
600158	中体产业	18.68	-37.38	290.74	-8.91
600266	北京城建	12.07	-36.44	155.03	-5.26
601111	中国国航	7.74	-34.13	219.61	-12.37
600588	用友网络	25.88	-33.93	169.55	-11.24

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	13.80	-2.68	45.42	2.34
000651	格力电器	18.45	-17.30	54.94	1.68
000725	京东方 A	3.07	-17.03	92.65	1.44
000001	平安银行	11.07	-10.44	39.11	1.39
000333	美的集团	28.79	-13.15	33.25	1.17
贡献前 5 名样本股					
代码	简称	收盘	涨跌幅%	换手率%	贡献点数
000601	韶能股份	12.60	49.87	105.89	7.88
000425	徐工机械	13.05	18.42	153.54	6.26
000875	吉电股份	12.40	22.41	309.66	5.39
002024	苏宁云商	14.41	4.50	140.30	5.27
300216	千山药机	47.74	24.97	56.65	4.99
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
000601	韶能股份	12.60	49.87	105.89	7.88
300216	千山药机	47.74	24.97	56.65	4.99
000875	吉电股份	12.40	22.41	309.66	5.39
000666	经纬纺机	17.70	21.48	156.90	1.98
002151	北斗星通	54.26	19.94	143.40	2.12
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
002268	卫士通	41.37	-51.21	108.57	-21.27
300228	富瑞特装	39.24	-46.71	145.10	-6.65
002477	雏鹰农牧	12.45	-44.98	146.00	-8.64
300178	腾邦国际	18.85	-43.97	167.96	-8.76
300020	银江股份	14.80	-43.83	100.92	-10.14

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	13.80	-2.68	45.42	5.11
000651	格力电器	18.45	-17.30	54.94	3.67
000725	京东方 A	3.07	-17.03	92.65	3.13
000001	平安银行	11.07	-10.44	39.11	3.03
000333	美的集团	28.79	-13.15	33.25	2.55
贡献前 5 名样本股					
代码	简称	收盘	涨跌幅%	换手率%	贡献点数
000425	徐工机械	13.05	18.42	153.54	4.78
002024	苏宁云商	14.41	4.50	140.30	4.03
300058	蓝色光标	14.30	9.08	9.24	2.43
000800	一汽轿车	17.51	6.51	147.18	1.39
000876	新希望	18.99	4.11	32.48	1.18
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
000425	徐工机械	13.05	18.42	153.54	4.78
300058	蓝色光标	14.30	9.08	9.24	2.43
000800	一汽轿车	17.51	6.51	147.18	1.39
002024	苏宁云商	14.41	4.50	140.30	4.03
000876	新希望	18.99	4.11	32.48	1.18
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
000709	河北钢铁	4.44	-36.57	45.86	-18.35
300168	万达信息	23.49	-34.22	159.87	-13.03
300024	机器人	57.01	-33.57	116.55	-22.24
300059	东方财富	33.19	-32.95	168.19	-29.03
002673	西部证券	16.51	-32.25	111.75	-12.43

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	13.79	-9.87	207.23	3.99
002183	怡亚通	73.15	0.00	0.00	3.42
002450	康得新	34.92	14.12	95.78	3.11
002415	海康威视	32.39	-27.70	47.27	3.04
002230	科大讯飞	37.27	6.67	154.38	2.23
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	14.41	4.50	140.30	14.97
002266	浙富控股	9.57	13.25	232.71	9.00
002151	北斗星通	54.26	19.94	143.40	6.01
002001	新和成	15.23	-5.76	100.98	-2.69
002429	兆驰股份	9.04	-7.85	66.81	-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
002151	北斗星通	54.26	19.94	143.40	6.01
002266	浙富控股	9.57	13.25	232.71	9.00
002024	苏宁云商	14.41	4.50	140.30	14.97
002142	宁波银行	12.47	-5.24	67.79	-7.27
002001	新和成	15.23	-5.76	100.98	-2.69
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
002340	格林美	10.00	-33.82	98.37	-32.35
002673	西部证券	16.51	-32.25	111.75	-46.09
002073	软控股份	12.11	-32.00	89.58	-20.91
002312	三泰控股	17.94	-31.53	214.21	-21.15
002063	远光软件	15.39	-30.68	138.89	-17.76

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	14.41	4.50	140.30	2.70
002183	怡亚通	73.15	0.00	0.00	2.22
002415	海康威视	32.39	0.00	0.00	1.97
002450	康得新	30.80	-11.80	79.06	1.78
002594	比亚迪	49.85	-10.34	81.31	1.20
贡献前 5 名样本股					
代码	简称	收盘	涨跌幅%	换手率%	贡献点数
002070	众和股份	16.00	64.10	178.71	1.86
002024	苏宁云商	14.41	4.50	140.30	1.70
002266	浙富控股	9.57	13.25	232.71	1.02
002176	江特电机	25.45	18.98	90.55	0.84
002151	北斗星通	54.26	19.94	143.40	0.68
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
002070	众和股份	16.00	64.10	178.71	1.86
002151	北斗星通	54.26	19.94	143.40	0.68
002176	江特电机	25.45	18.98	90.55	0.84
002118	紫鑫药业	16.75	15.52	265.79	0.39
002266	浙富控股	9.57	13.25	232.71	1.02
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
002288	超华科技	7.66	-56.85	113.70	-3.92
002268	卫士通	41.37	-51.21	108.57	-6.85
002477	雏鹰农牧	12.45	-44.98	146.00	-2.78
002170	芭田股份	10.12	-40.96	274.36	-2.43
002690	美亚光电	21.49	-40.64	50.47	-2.34

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	33.19	-32.95	168.19	4.61
300027	华谊兄弟	39.58	0.00	0.00	4.10
300104	乐视网	33.83	-31.64	123.85	4.07
300024	机器人	57.01	-33.57	116.55	3.44
300070	碧水源	43.40	-8.63	35.66	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
300216	千山药机	47.74	24.97	56.65	5.95
300058	蓝色光标	14.30	9.08	9.24	3.79
300182	捷成股份	37.07	18.81	62.55	2.57
300363	博腾股份	34.53	15.10	17.29	1.15
300026	红日药业	18.49	3.01	88.68	0.54
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
300216	千山药机	47.74	24.97	56.65	5.95
300182	捷成股份	37.07	18.81	62.55	2.57
300363	博腾股份	34.53	15.10	17.29	1.15
300058	蓝色光标	14.30	9.08	9.24	3.79
300026	红日药业	18.49	3.01	88.68	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
300047	天源迪科	12.34	-57.54	247.93	-9.11
300228	富瑞特装	39.24	-46.71	145.10	-7.93
300178	腾邦国际	18.85	-43.97	167.96	-10.44
300020	银江股份	14.80	-43.83	100.92	-12.09
300033	同花顺	41.37	-41.26	128.78	-13.57

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	30.29	-9.23	47.80	3.76
600036	招商银行	17.05	-1.45	27.03	3.22
600016	民生银行	8.57	-5.72	17.94	2.90
600000	浦发银行	14.96	-0.73	31.51	1.92
601166	兴业银行	14.58	-6.18	47.05	1.91
贡献前 5 名样本股					
代码	简称	收盘	涨跌幅%	换手率%	贡献点数
601169	北京银行	9.40	7.06	45.45	2.44
601866	中海集运	8.73	21.08	44.30	1.83
601919	中国远洋	11.63	14.92	46.52	1.79
601618	中国中冶	7.79	12.25	120.85	1.57
600050	中国联通	6.55	5.81	121.54	1.21
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	8.73	21.08	44.30	1.83
000425	徐工机械	13.05	18.42	153.54	1.10
601919	中国远洋	11.63	14.92	46.52	1.79
601618	中国中冶	7.79	12.25	120.85	1.57
600018	上港集团	7.84	9.19	119.82	0.67
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
000709	河北钢铁	4.44	-36.57	45.86	-4.24
601111	中国国航	7.74	-34.13	219.61	-3.94
600588	用友网络	25.88	-33.93	169.55	-3.61
300024	机器人	57.01	-33.57	116.55	-5.08
300059	东方财富	33.19	-32.95	168.19	-7.44

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	1.27
601718	际华集团	17.91	14.51	281.06	0.77
600978	宜华木业	22.33	0.00	0.00	0.74
000748	长城信息	34.88	0.00	0.00	0.63
000566	海南海药	49.97	0.00	0.00	0.61
贡献前 5 名样本股					
代码	简称	收盘	涨跌幅%	换手率%	贡献点数
600058	五矿发展	37.31	37.17	66.09	7.91
601718	际华集团	17.91	14.51	281.06	6.29
600006	东风汽车	13.38	45.28	338.69	6.05
600628	新世界	20.02	47.70	244.37	5.03
600428	中远航运	14.25	21.90	60.29	4.03
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
600628	新世界	20.02	47.70	244.37	5.03
600006	东风汽车	13.38	45.28	338.69	6.05
600058	五矿发展	37.31	37.17	66.09	7.91
600073	上海梅林	13.49	30.79	77.27	2.73
600259	广晟有色	48.45	27.27	46.74	2.50
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
600366	宁波韵升	16.56	-52.81	112.97	-12.64
600395	盘江股份	7.64	-50.87	62.46	-7.22
600869	智慧能源	13.91	-46.97	205.10	-6.71
002477	雏鹰农牧	12.45	-44.98	146.00	-7.93
600702	沱牌舍得	14.50	-44.42	83.11	-5.69

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	30.29	-9.23	47.80	1.75
600016	民生银行	8.57	-5.72	17.94	1.23
600036	招商银行	17.05	-1.45	27.03	1.06
600000	浦发银行	14.96	-0.73	31.51	0.89
601166	兴业银行	14.58	-6.18	47.05	0.80
贡献前 5 名样本股					
代码	简称	收盘	涨跌幅%	换手率%	贡献点数
600868	梅雁吉祥	7.09	73.35	469.34	1.20
601169	北京银行	9.40	7.06	45.45	1.19
600058	五矿发展	37.31	37.17	66.09	0.85
601866	中海集运	8.73	21.08	44.30	0.82
601919	中国远洋	11.63	14.92	46.52	0.71
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
002464	金利科技	47.07	99.20	279.07	0.22
000526	银润投资	40.28	80.63	183.65	0.22
600868	梅雁吉祥	7.09	73.35	469.34	1.20
600838	上海九百	15.91	66.89	472.63	0.39
002070	众和股份	16.00	64.10	178.71	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
300419	浩丰科技	88.99	-62.99	244.87	-0.33
000567	海德股份	13.80	-59.06	235.12	-0.42
300047	天源迪科	12.34	-57.54	247.93	-0.77
002620	瑞和股份	24.80	-57.53	233.36	-0.31
002329	皇氏集团	29.97	-56.87	141.74	-0.88

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:

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

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:

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

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:

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

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。