

广发基金指数月报

(2015 年 8 月 3 日—2015 年 8 月 31 日)

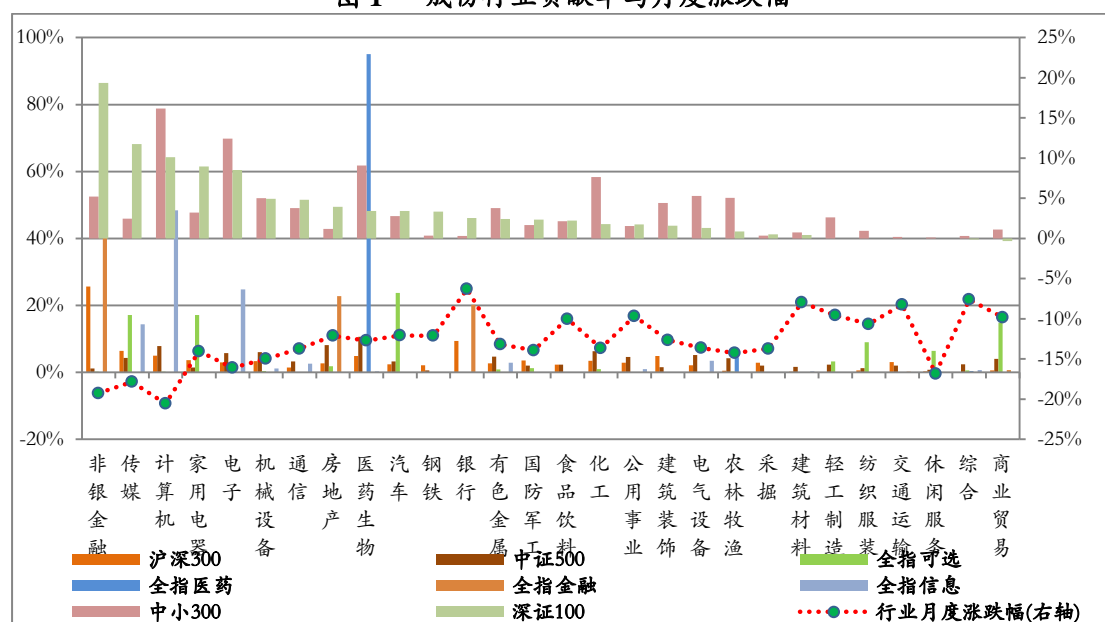
广发基金数量投资部

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%。

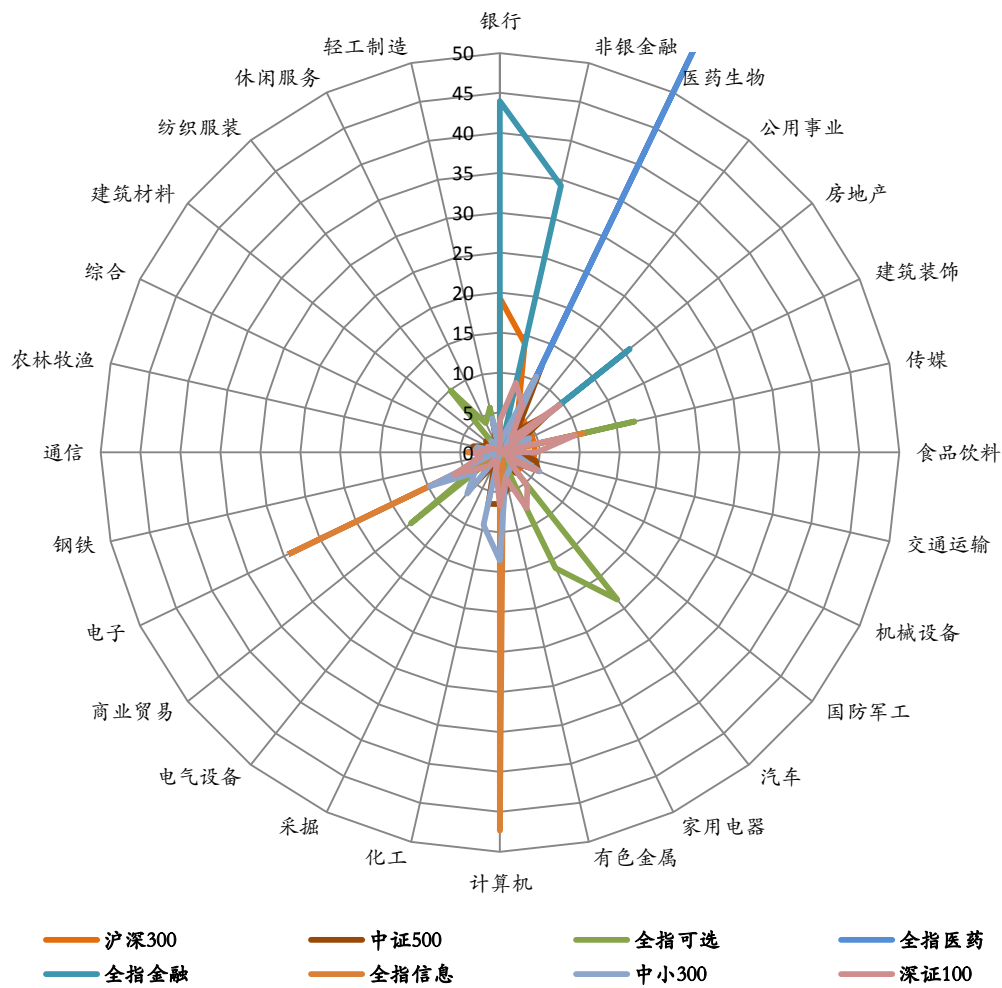
图 1 成份行业贡献率与月度涨跌幅



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

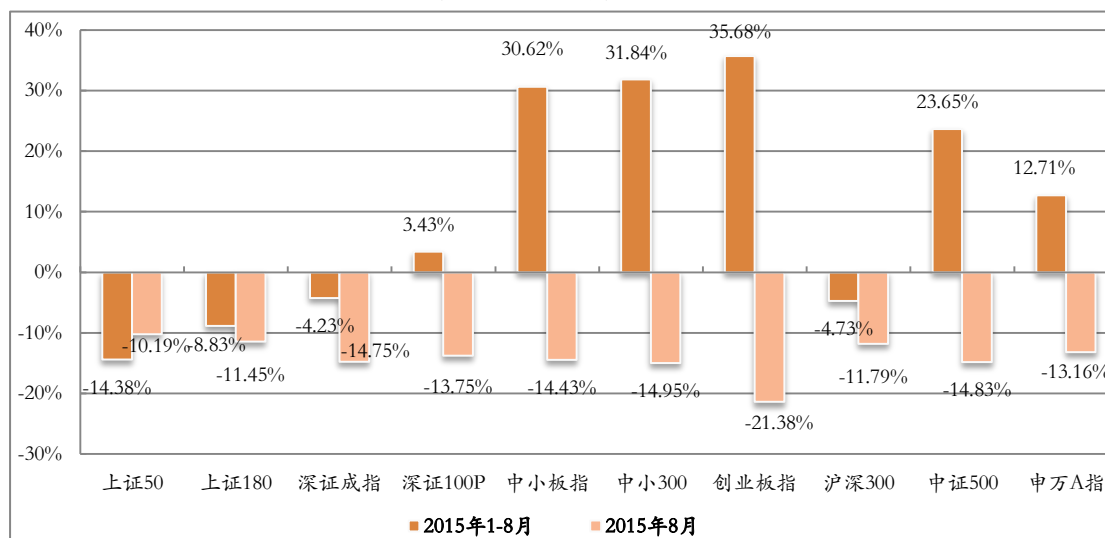


图 4 核心指数本月绝对收益

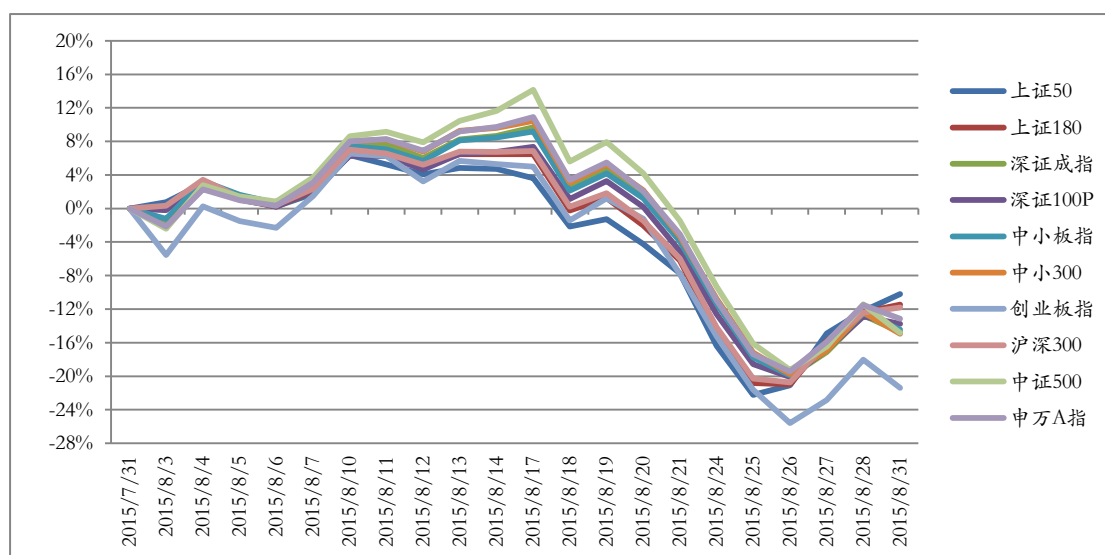
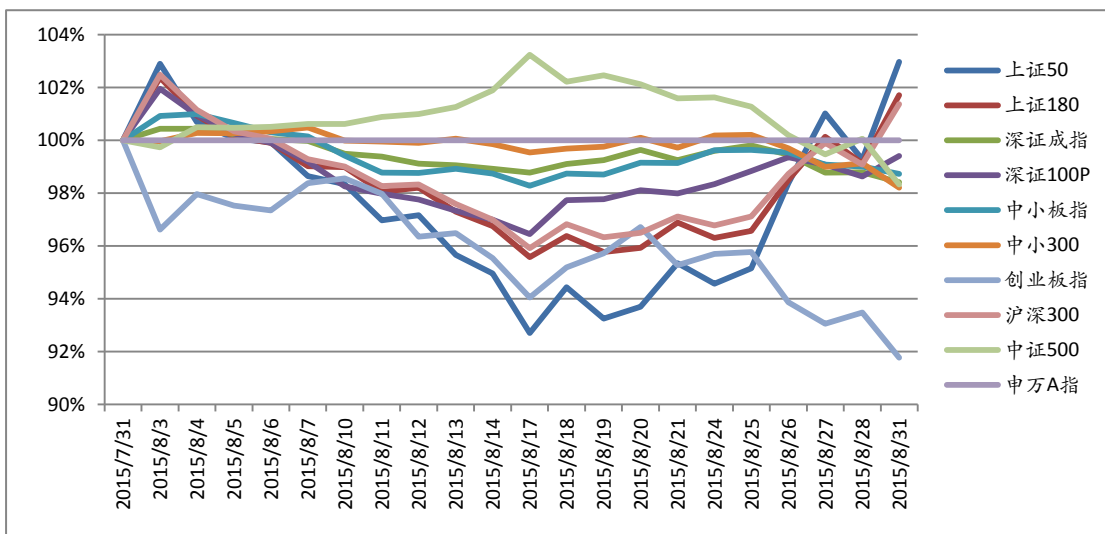


图 5 核心指数本月超额收益对比



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

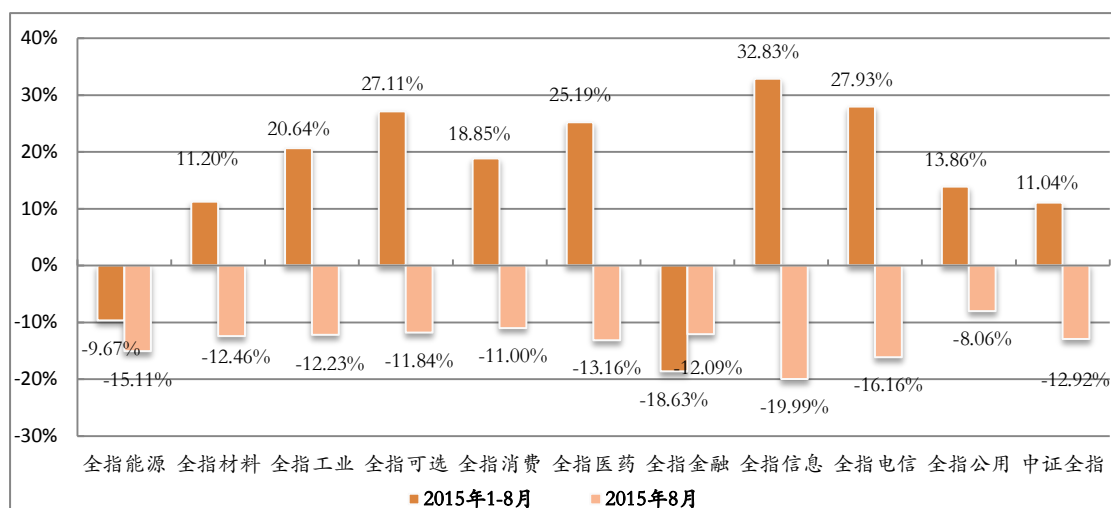


图 7 行业指数本月绝对收益

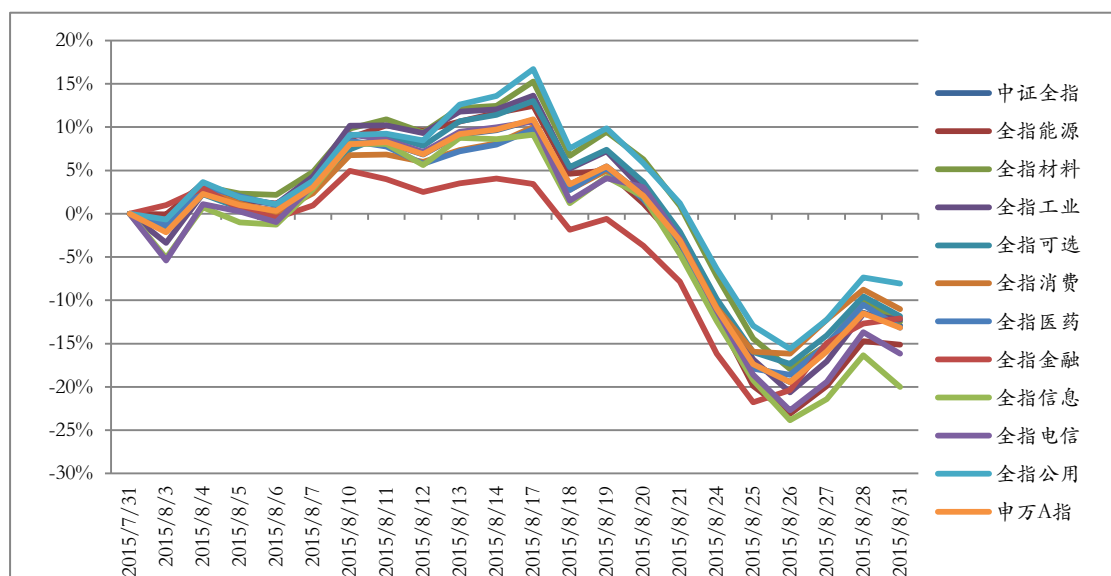
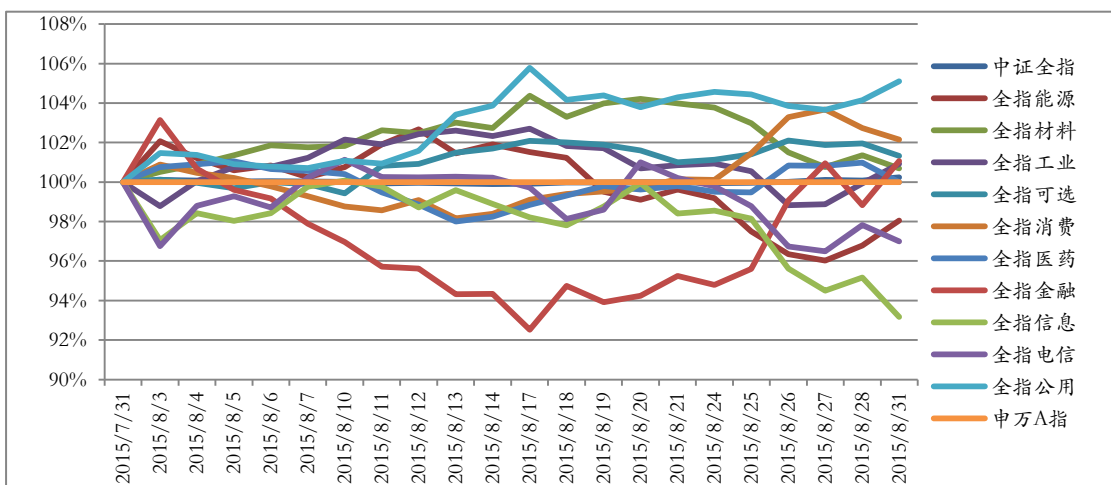


图 8 行业指数本月超额收益对比



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：

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

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。