

# 广发基金指数月报

(2015 年 10 月 8 日—2015 年 10 月 30 日)

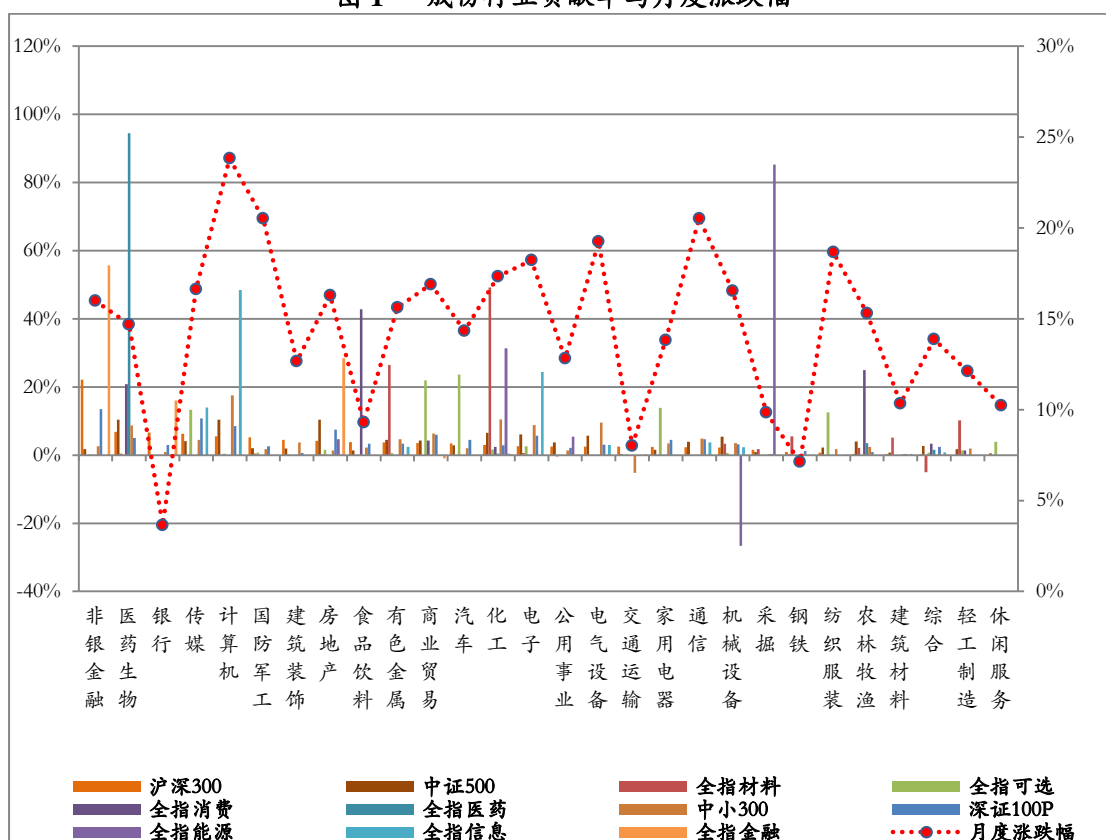
广发基金数量投资部

## 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

本月市场止跌反弹，申万 28 个一级行业全部上涨，计算机、通讯和国防军工行业涨幅均超过 20%。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 22.15%；计算机行业对中证 500 指数贡献最大，贡献率为 10.38%；计算机行业对中小 300 指数贡献居首，贡献率为 17.5%；非银金融行业对深证 100 指数贡献最大，贡献率为 13.5%。

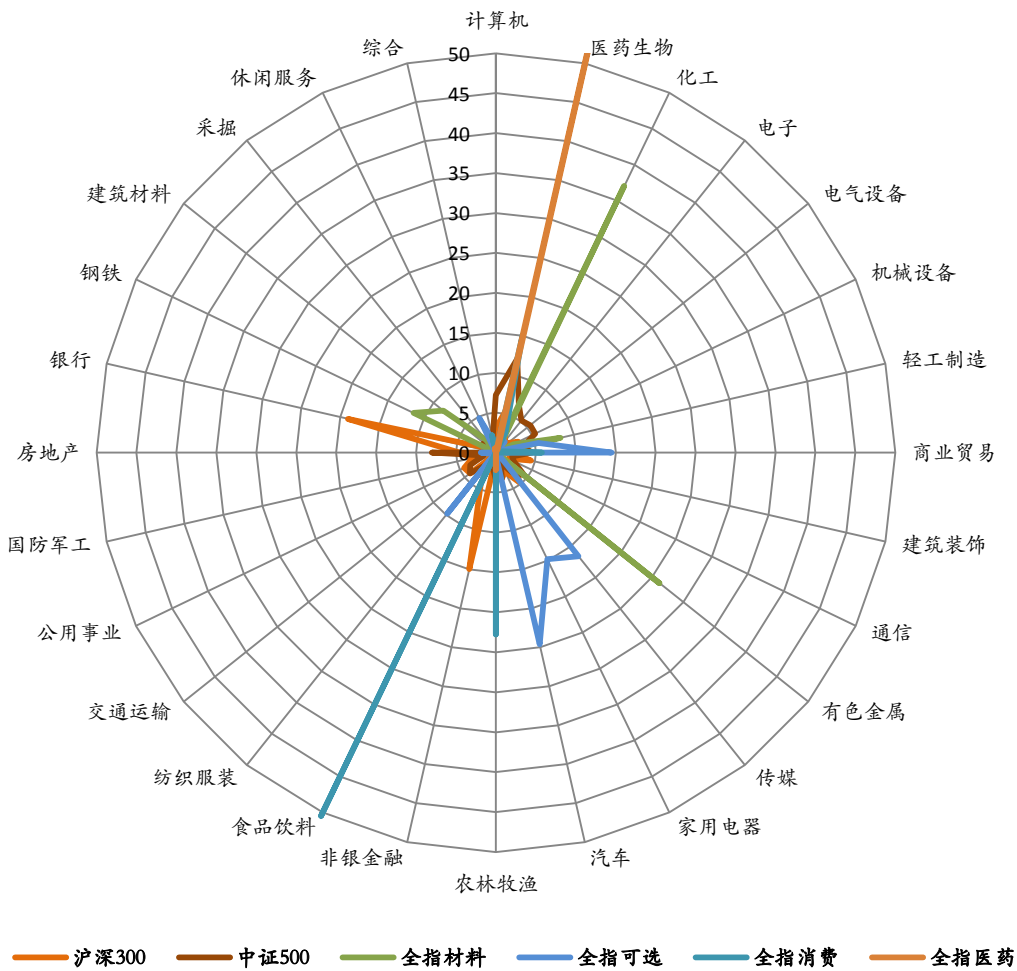
图 1 成份行业贡献率与月度涨跌幅

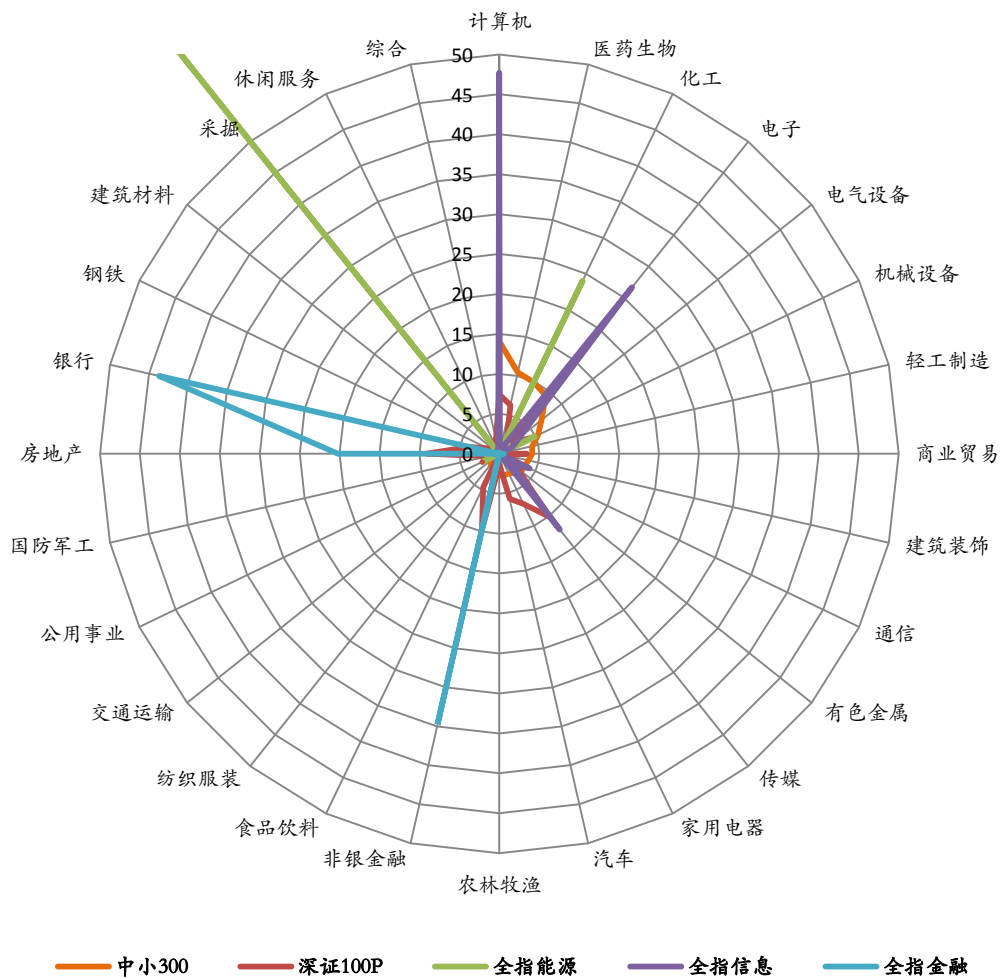


以巨潮数据库提供的权重数据计算，本月末银行业在沪深 300 指数中所占权

重居首，为 19.0%。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 12.07%、8.02%和 7.24%。计算机、医药生物和化工行业在中小 300 指数中权重居前，分别为 14.08%、10.47%和 9.94%。传媒、非银金融和地产在深证 100 指数中权重位列前三，依次为 10.16%、9.77%和 9.12%。

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 1.70%。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、广发全指金融地产 ETF、广发全指原材料 ETF、广发全指能源 ETF、广发全指主要消费 ETF 的年化跟踪误差最大值为 3.28%。

表 1 基金净值与跟踪误差

基金简称	2015 年 10 月		2015 年 9 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	1.4672	1.4672	1.2883	1.2883	1.2480	2009/11/26
广发沪深 300	1.5570	1.8470	1.4070	1.6970	2.1836	2008/12/30
广发中小板 300ETF	1.5646	1.4215	1.3257	1.2045	1.7023	2011/6/3

广发中小板 300 联接	1.2982	1.2982	1.1147	1.1147	1.3697	2011/6/9
广发深证 100 分级	1.0727	1.1606	0.9313	1.0192	4.7012	2012/5/7
广发中证 500ETF	1.9354	1.9354	1.6893	1.6893	1.0150	2013/4/11
广发全指可选消费 ETF	1.6648	1.6648	1.4717	1.4717	1.3983	2014/6/3
广发全指医药卫生 ETF	1.3736	1.3736	1.1903	1.1903	1.1614	2014/12/1
广发全指信息技术 ETF	1.2765	1.2765	1.0453	1.0453	0.2353	2015/1/8
广发全指金融地产 ETF	0.7621	0.7621	0.6941	0.6941	0.3786	2015/3/23
广发全指原材料 ETF	0.8194	0.8194	0.7089	0.7089	2.1332	2015/6/25
广发全指能源 ETF	0.7036	0.7036	0.6385	0.6385	3.2838	2015/6/25
广发全指主要消费 ETF	0.9145	0.9145	0.8198	0.8198	1.0654	2015/7/1

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

10 月沪深两市止跌回升，覆盖两市的申万 A 指上涨 14.57%。指数方面，本期核心市场指数中，创业板指涨幅最大，上涨 19.0%；上证 50 表现最差，上涨 7.77%。

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	2146.12	2231.02	2381.71	2189.99	2312.97	7.77%	9261.55
上证 180	7030.86	7299.47	7886.52	7211.11	7685.71	9.31%	22697.10
深证成指	9988.25	10332.24	11834.07	10265.00	11546.05	15.60%	42283.86
深证 100P	3460.60	3592.37	4016.56	3568.65	3925.72	13.44%	14653.35
中小板指	6779.70	7020.13	7986.57	6970.21	7795.92	14.99%	9895.67
中小板 300	1392.94	1439.59	1663.21	1429.94	1623.52	16.55%	21167.69
创业板指	2082.67	2153.12	2586.95	2138.54	2478.28	19.00%	9419.38
沪深 300	3202.95	3324.98	3620.76	3293.97	3534.08	10.34%	37223.81
中证 500	6123.73	6322.54	7270.79	6281.53	7084.97	15.70%	31817.39
申万 A 指	3313.67	3425.76	3874.26	3401.35	3796.51	14.57%	150210.73

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	1956.93	2035.23	2215.14	2002.85	2107.12	7.67%	2710.78
全指材料	2869.71	2961.45	3340.47	2938.15	3267.67	13.87%	17107.28
全指工业	4162.34	4290.03	4899.05	4262.65	4757.92	14.31%	32779.29
全指可选	5462.29	5642.19	6332.11	5607.90	6223.38	13.93%	19088.78
全指消费	7403.30	7633.80	8348.41	7605.03	8221.78	11.06%	6055.38
全指医药	9061.55	9437.23	10843.06	9376.93	10425.57	15.05%	7465.94
全指金融	4869.11	5059.63	5509.29	4969.69	5348.99	9.86%	13000.92
全指信息	5770.21	5976.54	7253.20	5925.09	7056.26	22.29%	21869.28
全指电信	5314.10	5511.94	6665.81	5474.50	6430.92	21.02%	3977.65
全指公用	2837.07	2922.88	3234.61	2905.19	3138.72	10.63%	4233.86
中证全指	<b>4460.10</b>	<b>4610.88</b>	<b>5195.34</b>	<b>4578.30</b>	<b>5090.64</b>	<b>14.14%</b>	<b>142235.66</b>

图 3 核心指数月度表现

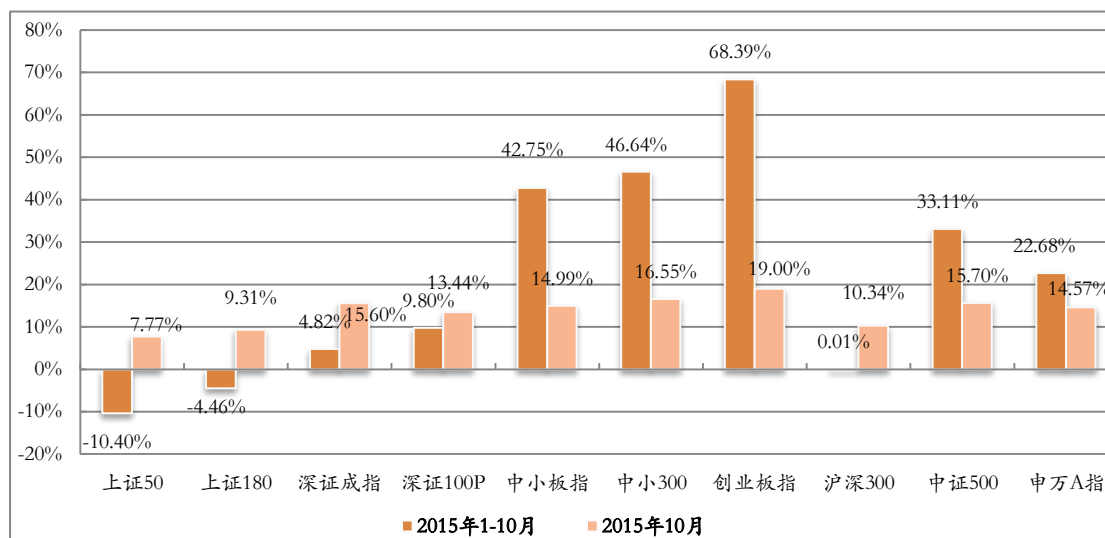


图 4 核心指数本月绝对收益

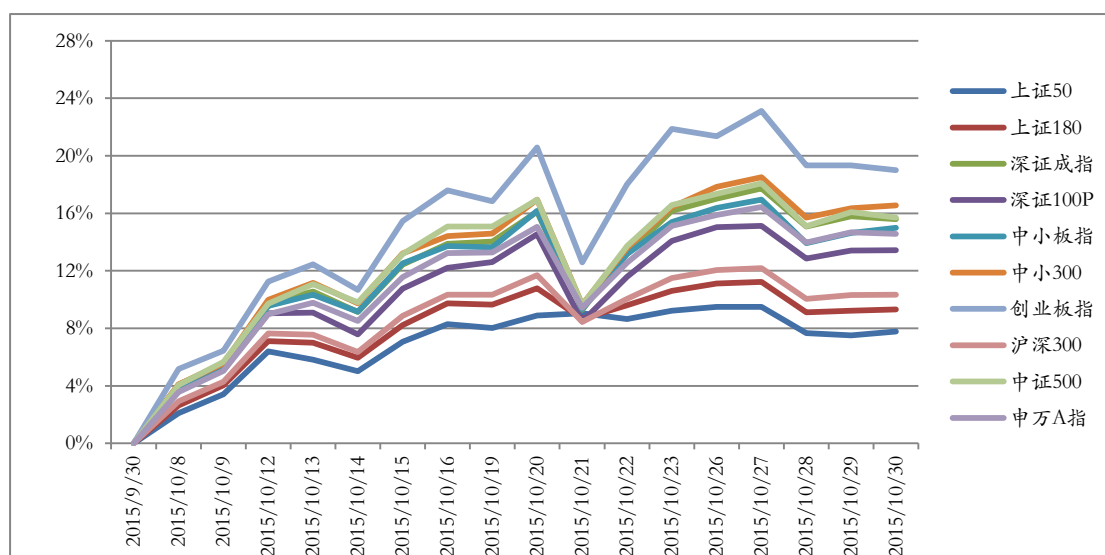
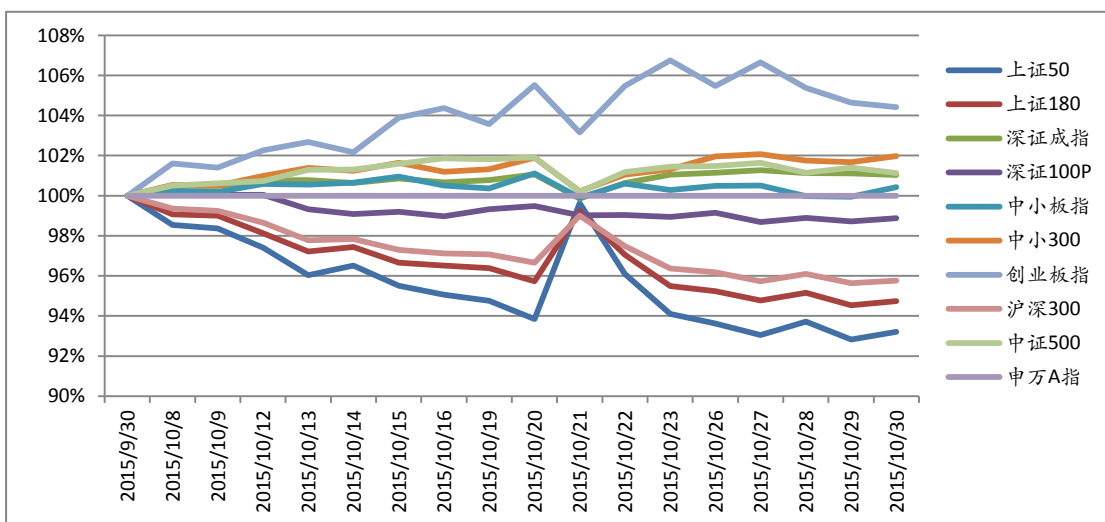


图 5 核心指数本月超额收益对比



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

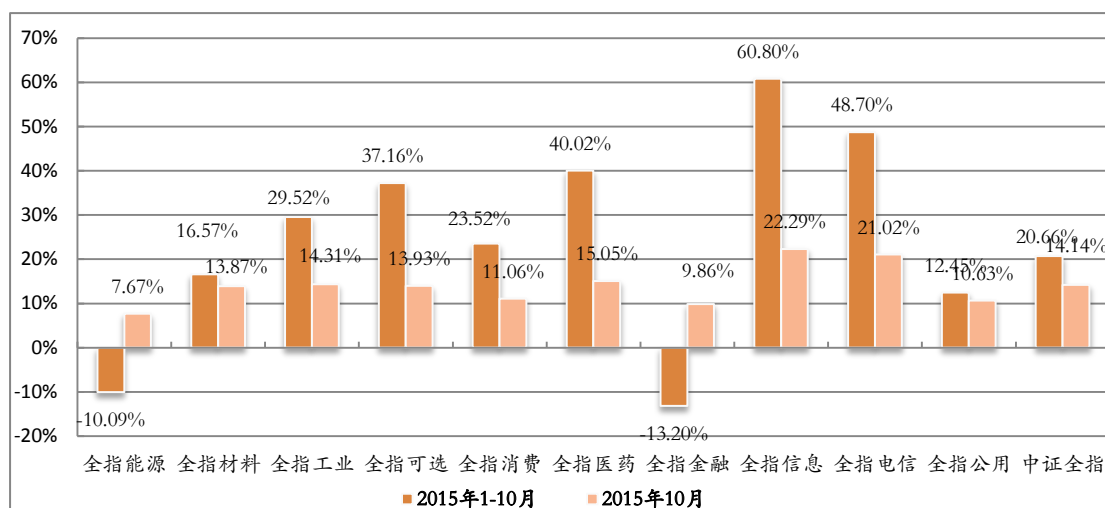


图 7 行业指数本月绝对收益

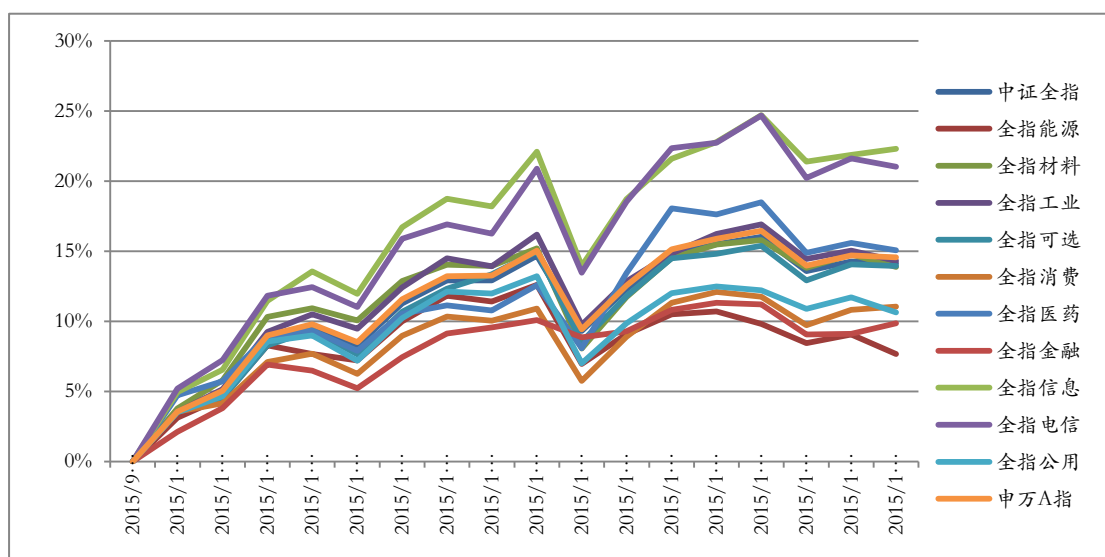
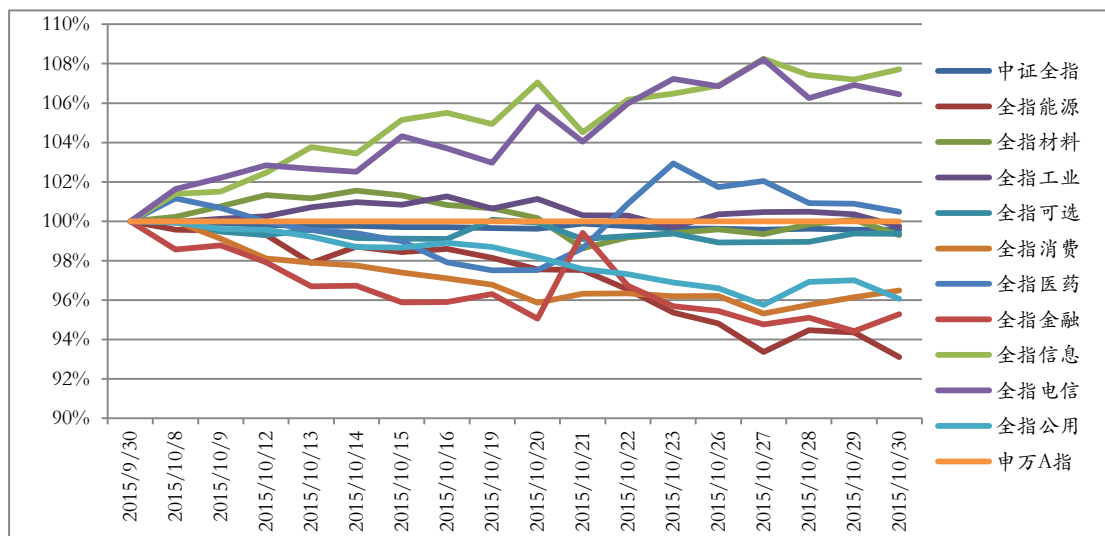


图 8 行业指数本月超额收益对比



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 10 月份核心指数的估值水平小幅回升，市场平均动态（2016 年）市盈率为 16.22 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 9.57 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	16.81	10.00	9.57	1.17
上证 180	18.81	11.09	10.56	1.32
深证成指	54.74	29.63	25.77	3.29
深证 100	36.47	20.20	18.66	2.62
中小板指	64.12	34.18	30.52	4.71
中小 300	79.04	41.25	35.16	4.76
创业板指	153.38	72.04	56.24	8.82
沪深 300	21.24	12.41	11.75	1.49
中证 500	76.27	39.92	32.52	3.22
申万 A 指	31.97	18.46	16.22	2.07

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	41.41	29.96	23.42	1.07
全指材料	81.78	42.12	34.15	2.25
全指工业	62.91	32.29	27.21	2.74
全指可选	50.88	27.39	22.74	3.20
全指消费	50.34	29.03	24.96	3.67
全指医药	80.68	45.35	38.75	5.14
全指金融	13.78	8.20	7.87	1.22
全指信息	139.51	66.68	50.88	6.06
全指电信	104.18	51.11	40.34	2.12
全指公用	31.15	17.40	15.03	1.90
中证全指	31.27	18.02	15.86	2.02



## 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	33.49	12.16	16.08	9.30
600036	招商银行	17.93	0.90	8.84	7.58
600016	民生银行	8.60	1.78	6.45	6.51
600000	浦发银行	16.39	-1.44	9.15	4.70
601166	兴业银行	15.27	4.88	20.47	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
601318	中国平安	33.49	12.16	16.08	23.31
600030	中信证券	15.87	16.86	54.89	10.69
600837	海通证券	14.84	16.39	30.81	10.03
601688	华泰证券	17.68	27.01	41.37	7.31
600519	贵州茅台	213.86	12.37	9.38	7.02
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
601688	华泰证券	17.68	27.01	41.37	7.31
600958	东方证券	20.75	26.76	63.72	2.74
600109	国金证券	14.91	23.22	87.30	3.02
600518	康美药业	16.65	23.15	46.52	5.73
600999	招商证券	19.10	22.66	39.10	4.92
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
600000	浦发银行	16.39	-1.44	9.15	-1.60
600036	招商银行	17.93	0.90	8.84	1.57
600016	民生银行	8.60	1.78	6.45	2.63
601169	北京银行	8.77	1.86	0.75	0.96
600018	上港集团	7.14	2.44	44.33	0.25

## 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	33.49	12.16	16.08	5.67
600036	招商银行	17.93	0.90	8.84	4.63
600016	民生银行	8.60	1.78	6.45	3.97
600000	浦发银行	16.39	-1.44	9.15	2.87
601166	兴业银行	15.27	4.88	20.47	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
601318	中国平安	33.49	12.16	16.08	47.25
600030	中信证券	15.87	16.86	54.89	21.65
600837	海通证券	14.84	16.39	30.81	20.32
601688	华泰证券	17.68	27.01	41.37	14.80
600519	贵州茅台	213.86	12.37	9.38	14.22
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	13.75	53.98	311.45	5.54
600570	恒生电子	64.71	48.15	138.09	12.32
600765	中航重机	22.31	40.85	137.77	3.63
600118	中国卫星	49.47	38.26	146.26	9.69
600415	小商品城	10.38	37.67	114.15	9.25
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
600645	中源协和	54.74	-31.01	159.99	-7.99
600383	金地集团	11.40	-4.44	11.88	-1.42
600000	浦发银行	16.39	-1.44	9.15	-3.25
601098	中南传媒	21.62	-0.55	37.50	-0.05
601118	海南橡胶	7.38	-0.14	128.92	-0.04

### 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	13.67	7.38	12.99	2.12
000651	格力电器	17.35	7.23	29.03	1.44
000001	平安银行	11.36	8.29	18.95	1.30
000725	京东方 A	2.98	6.81	49.89	1.27
002024	苏宁云商	16.26	34.16	163.17	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
300059	东方财富	53.42	48.47	187.67	40.60
002024	苏宁云商	16.26	34.16	163.17	35.21
300024	机器人	77.26	36.26	99.87	20.76
002230	科大讯飞	37.35	39.37	105.72	18.60
300033	同花顺	86.65	119.31	248.37	18.47
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
002085	万丰奥威	29.10	77.87	82.18	10.46
002067	景兴纸业	8.65	59.60	164.03	6.57
002407	多氟多	36.55	47.14	396.90	4.59
300226	上海钢联	52.94	43.47	322.10	3.57
300367	东方网力	56.37	42.42	58.28	5.73
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
300316	晶盛机电	14.98	-42.16	156.75	-7.25
002183	怡亚通	44.79	-38.77	76.62	-38.99
002353	杰瑞股份	26.05	-34.74	161.66	-13.71
000566	海南海药	36.42	-27.12	22.96	-11.52
002369	卓翼科技	14.61	-27.06	0.32	-3.66

#### 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	13.67	7.38	12.99	4.77
000651	格力电器	17.35	7.23	29.03	3.25
000001	平安银行	11.36	8.29	18.95	2.92
000725	京东方 A	2.98	6.81	49.89	2.86
002024	苏宁云商	16.26	34.16	163.17	2.69
贡献前 5 名样本股					
代码	简称	收盘	涨跌幅%	换手率%	贡献点数
300059	东方财富	53.42	48.47	187.67	31.05
002024	苏宁云商	16.26	34.16	163.17	26.93
300024	机器人	77.26	36.26	99.87	15.88
002230	科大讯飞	37.35	39.37	105.72	14.22
000002	万科 A	13.67	7.38	12.99	12.86
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
000009	中国宝安	16.00	51.09	207.08	11.17
300059	东方财富	53.42	48.47	187.67	31.05
002230	科大讯飞	37.35	39.37	105.72	14.22
002570	贝因美	18.56	39.34	225.71	4.43
000728	国元证券	22.12	37.91	89.91	10.22
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
002353	杰瑞股份	26.05	-34.74	161.66	-10.49
300027	华谊兄弟	36.90	-6.77	53.16	-3.56
002030	达安基因	45.04	2.60	109.73	0.83
000629	攀钢钒钛	3.03	3.06	53.89	0.54
000061	农产品	14.80	3.28	105.88	0.92

## 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	16.26	34.16	163.17	5.03
002415	海康威视	34.63	6.29	35.22	3.47
002450	康得新	35.75	18.03	37.81	3.40
002594	比亚迪	67.10	11.81	98.82	2.66
002230	科大讯飞	37.35	39.37	105.72	2.39
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	16.26	34.16	163.17	99.86
002230	科大讯飞	37.35	39.37	105.72	52.73
002450	康得新	35.75	18.03	37.81	40.50
002465	海格通信	16.25	27.25	68.60	31.01
002673	西部证券	21.38	32.06	116.40	30.43
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
002095	生意宝	73.01	86.25	373.54	20.87
002181	粤传媒	12.16	48.29	208.04	8.70
002004	华邦健康	13.69	46.73	126.82	28.67
002178	延华智能	12.38	43.29	90.15	9.51
002051	中工国际	24.42	41.98	78.71	14.09
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
002183	怡亚通	44.79	-38.77	76.62	-110.58
002353	杰瑞股份	26.05	-34.74	161.66	-38.89
002252	上海莱士	40.84	-1.59	37.49	-2.02
002030	达安基因	45.04	2.60	109.73	3.07
002250	联化科技	18.38	2.68	67.89	1.57

## 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	16.26	34.16	163.17	2.74
002415	海康威视	34.63	6.29	35.22	1.89
002450	康得新	35.75	18.03	37.81	1.85
002594	比亚迪	67.10	11.81	98.82	1.45
002230	科大讯飞	37.35	39.37	105.72	1.31
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	16.26	34.16	163.17	11.34
002230	科大讯飞	37.35	39.37	105.72	5.99
002450	康得新	35.75	18.03	37.81	4.60
002276	万马股份	30.61	51.84	392.67	3.58
002465	海格通信	16.25	27.25	68.60	3.52
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
002432	九安医疗	29.01	120.27	291.75	1.98
002095	生意宝	73.01	86.25	373.54	2.37
002123	荣信股份	21.56	71.79	129.94	2.35
002121	科陆电子	27.01	65.40	73.25	1.73
002496	辉丰股份	23.34	63.79	162.39	1.15
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
002183	怡亚通	44.79	-38.77	76.62	-12.56
002589	瑞康医药	32.74	-37.15	124.61	-2.51
002353	杰瑞股份	26.05	-34.74	161.66	-4.42
002574	明牌珠宝	15.07	-34.19	96.84	-1.43
002097	山河智能	9.35	-29.06	135.29	-1.23

## 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	53.42	48.47	187.67	5.93
300104	乐视网	47.85	17.05	109.19	4.60
300024	机器人	77.26	36.26	99.87	3.72
300027	华谊兄弟	36.90	-6.77	53.16	3.05
300017	网宿科技	60.26	14.32	66.60	2.76
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	53.42	48.47	187.67	47.99
300024	机器人	77.26	36.26	99.87	24.54
300033	同花顺	86.65	119.31	248.37	21.83
300104	乐视网	47.85	17.05	109.19	16.60
300001	特锐德	27.44	62.27	251.78	11.24
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
300033	同花顺	86.65	119.31	248.37	21.83
300352	北信源	53.00	80.89	212.67	7.82
300074	华平股份	15.32	67.25	262.45	5.16
300413	快乐购	45.45	66.48	335.15	3.33
300431	暴风科技	95.83	64.91	305.02	6.53
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
300096	易联众	26.00	-34.26	37.04	-7.18
300251	光线传媒	25.15	-8.51	174.95	-2.65
300027	华谊兄弟	36.90	-6.77	53.16	-5.50
300216	千山药机	47.60	-0.29	75.85	-0.09
300136	信维通信	27.85	0.29	60.68	0.07

## 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	33.49	12.16	16.08	3.96
600036	招商银行	17.93	0.90	8.84	3.23
600016	民生银行	8.60	1.78	6.45	2.77
600000	浦发银行	16.39	-1.44	9.15	2.00
601166	兴业银行	15.27	4.88	20.47	1.90
贡献前 5 名样本股					
代码	简称	收盘	涨跌幅%	换手率%	贡献点数
601318	中国平安	33.49	12.16	16.08	15.17
300059	东方财富	53.42	48.47	187.67	7.98
002024	苏宁云商	16.26	34.16	163.17	7.07
600030	中信证券	15.87	16.86	54.89	6.93
600837	海通证券	14.84	16.39	30.81	6.51
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
000009	中国宝安	16.00	51.09	207.08	2.68
000738	中航动控	34.10	50.95	185.44	2.05
300059	东方财富	53.42	48.47	187.67	7.98
600570	恒生电子	64.71	48.15	138.09	3.97
000503	海虹控股	35.05	45.62	178.98	3.08
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
002353	杰瑞股份	26.05	-34.74	161.66	-2.57
600277	亿利能源	9.95	-31.76	108.32	-1.85
300251	光线传媒	25.15	-8.51	174.95	-0.41
300027	华谊兄弟	36.90	-6.77	53.16	-1.01
600383	金地集团	11.40	-4.44	11.88	-0.45



## 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	44.79	-38.77	76.62	0.72
600978	宜华木业	22.33	0.00	0.00	0.69
000748	长城信息	34.88	0.00	0.00	0.59
600525	长园集团	21.04	0.00	0.00	0.57
600446	金证股份	45.00	33.10	48.71	0.56
贡献前 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	86.65	119.31	248.37	18.63
600446	金证股份	45.00	33.10	48.71	9.85
000547	航天发展	21.12	54.16	113.74	9.75
000540	中天城投	10.43	42.10	46.84	9.75
002276	万马股份	30.61	51.84	392.67	9.09
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
300033	同花顺	86.65	119.31	248.37	18.63
002698	博实股份	28.30	63.21	137.86	4.06
000988	华工科技	17.74	61.71	150.31	7.70
600478	科力远	18.40	61.26	76.53	8.34
000062	深圳华强	45.14	54.17	187.28	5.85
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
002183	怡亚通	44.79	-38.77	76.62	-32.32
002574	明牌珠宝	15.07	-34.19	96.84	-3.81
600645	中源协和	54.74	-31.01	159.99	-12.31
600499	科达洁能	21.42	-27.73	34.34	-8.46
002345	潮宏基	14.27	-27.12	0.87	-4.09

## 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	33.49	12.16	15.37	1.77
600016	民生银行	8.60	1.78	5.99	1.13
600036	招商银行	17.93	0.90	8.11	0.91
601166	兴业银行	15.27	4.88	19.20	0.76
600000	浦发银行	16.39	-1.44	9.15	0.74
贡献前 5 名样本股					
代码	简称	收盘	涨跌幅%	换手率%	贡献点数
601318	中国平安	33.49	12.16	15.37	6.61
600030	中信证券	15.87	16.86	50.71	3.45
002024	苏宁云商	16.26	34.16	155.12	3.44
300059	东方财富	53.42	48.47	174.13	2.77
600837	海通证券	14.84	16.39	28.76	2.37
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
000676	智度投资	30.73	276.59	104.06	0.98
300191	潜能恒信	44.00	201.78	247.42	0.56
000020	深华发 A	31.25	139.28	235.87	0.24
002432	九安医疗	29.01	120.27	279.81	0.67
300033	同花顺	86.65	119.31	239.31	1.50
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
300316	晶盛机电	14.98	-42.16	142.19	-0.63
600634	中技控股	22.10	-40.88	298.22	-1.06
002183	怡亚通	44.79	-38.77	76.62	-3.66
000668	荣丰控股	21.63	-37.83	139.38	-0.24
600186	莲花味精	6.52	-37.67	133.57	-0.64

## 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。