

广发基金指数月报

(2015 年 11 月 2 日—2015 年 11 月 30 日)

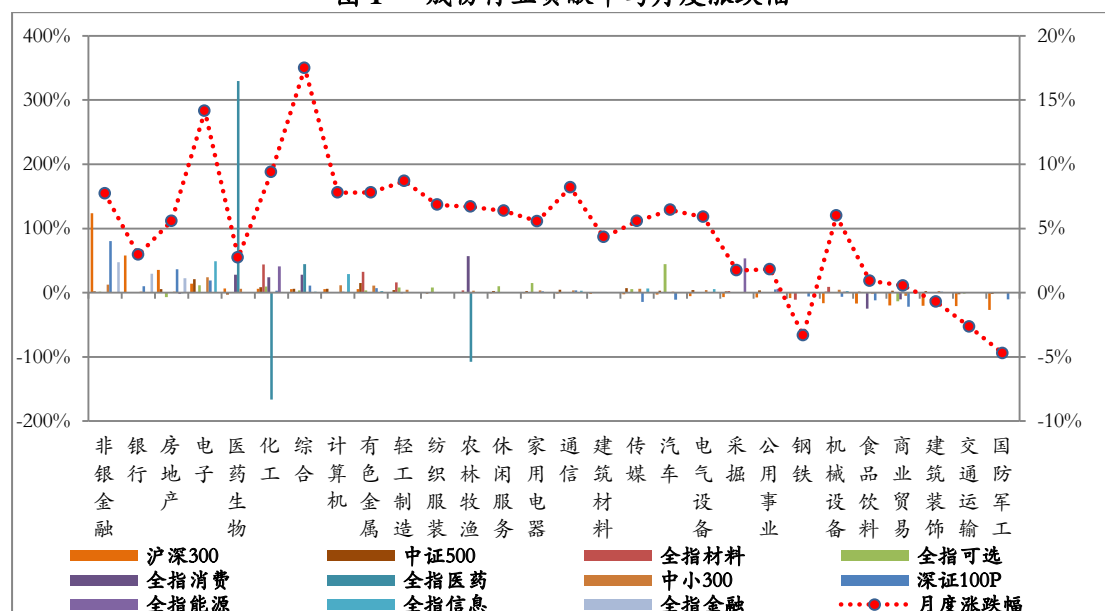
广发基金数量投资部

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

本月市场继续上涨，申万 28 个一级行业涨多跌少，综合和电子行业涨幅均在 14% 以上，国防军工、钢铁、交通运输和建筑装饰行业跌幅在 5% 以内。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 132.85%；电子行业对中证 500 指数贡献最大，贡献率为 20.79%；电子行业对中小 300 指数贡献居首，贡献率为 23.83%；非银金融行业对深证 100 指数贡献最大，贡献率为 80.25%。

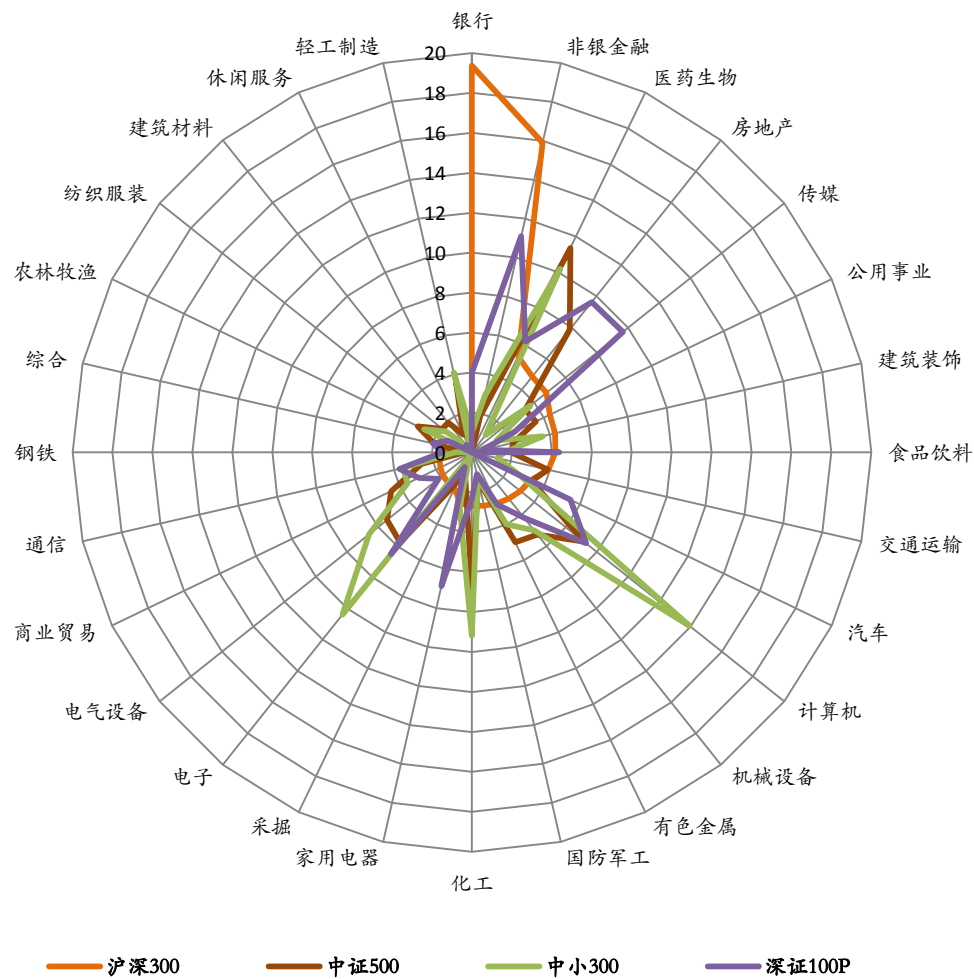
图 1 成份行业贡献率与月度涨跌幅

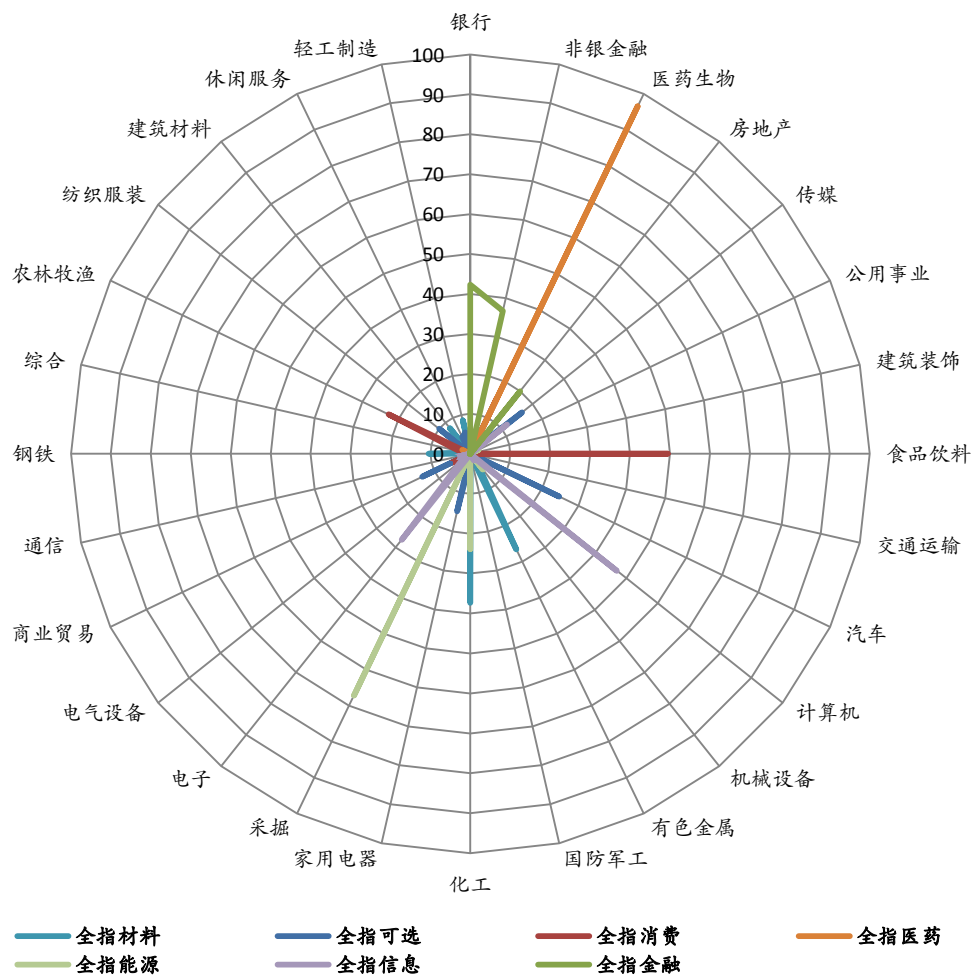


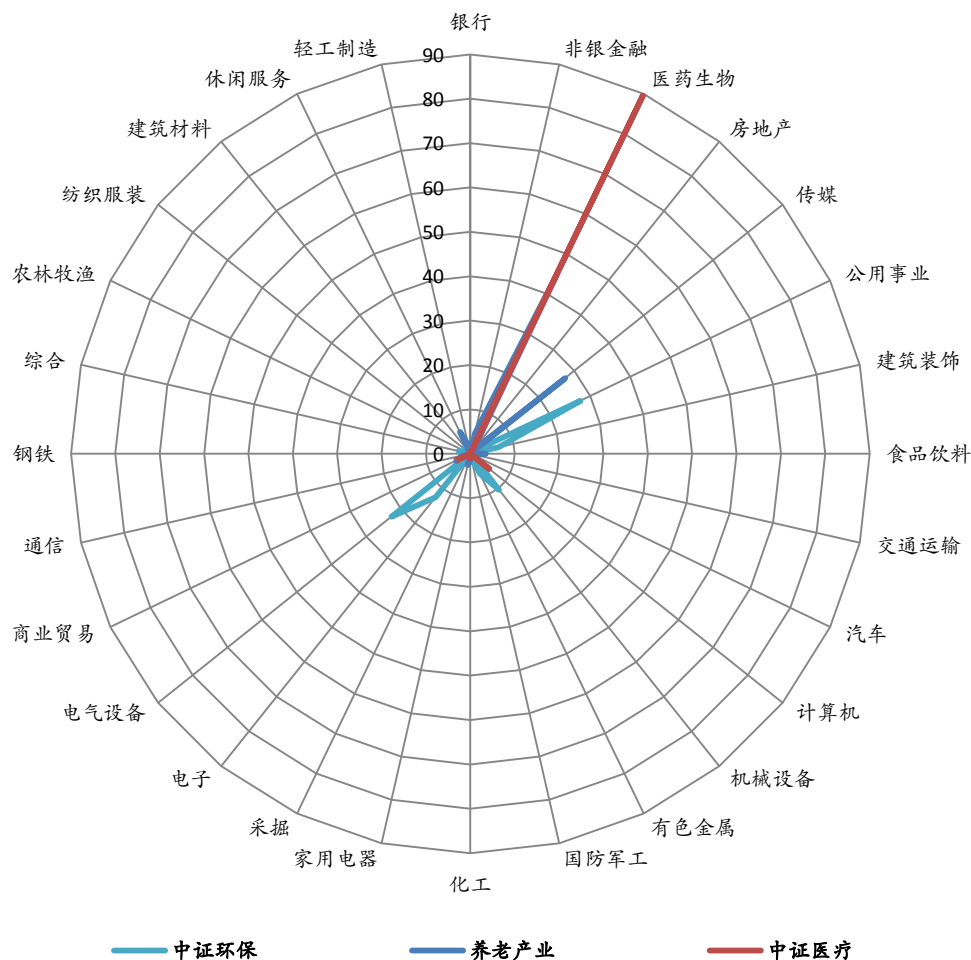
以巨潮数据库提供的权重数据计算，本月末银行业在沪深 300 指数中所占权重居首，为 19.4%。医药生物、房地产和计算机行业在中证 500 指数中权重居前，依次为 11.36%、7.87% 和 7.17%。计算机、电子和医药生物行业在中小 300 指数中权重居前，分别为 13.93%、10.40% 和 10.19%。非银金融、传媒和房地产在深

证 100 指数中权重位列前三，依次为 11.10%、9.67%和 9.62%。

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 0.66%。除广发深证 100 和中证医疗分级外，广发中证 500 联接、广发沪深 300、广发中小板 300 联接、广发中证养老产业、广发中证环保产业、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 和广发全指主要消费 ETF 的年化跟踪误差符合要求。

表 1 基金净值与跟踪误差

基金简称	2015 年 11 月		2015 年 10 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)		
广发沪深 300	1.5750	1.8650	1.5570	1.8470	0.5315	2008/12/30
广发中证 500ETF 联接	1.5316	1.5316	1.4672	1.4672	1.8320	2009/11/26
广发中小板 300ETF	1.6710	1.5182	1.5646	1.4215	0.6609	2011/6/3

广发中小板 300 联接	1.3827	1.3827	1.2982	1.2982	0.7409	2011/6/9
广发深证 100 分级	1.1007	1.1886	1.0727	1.1606	1.7294	2012/5/7
广发中证 500ETF	2.0213	2.0213	1.9354	1.9354	0.3799	2013/4/11
广发全指可选消费 ETF	1.7248	1.7248	1.6648	1.6648	0.8036	2014/6/3
广发全指医药卫生 ETF	1.3861	1.3861	1.3736	1.3736	0.6246	2014/12/1
广发全指信息技术 ETF	1.3883	1.3883	1.2765	1.2765	0.4547	2015/1/8
广发中证养老产业	1.0817	1.0817	1.0581	1.0581	2.9936	2015/2/13
广发全指金融地产 ETF	0.7993	0.7993	0.7621	0.7621	0.1493	2015/3/23
广发中证环保产业	0.8779	0.8779	0.8294	0.8294	3.3617	2015/3/25
广发全指原材料 ETF	0.8764	0.8764	0.8194	0.8194	1.2260	2015/6/25
广发全指能源 ETF	0.6953	0.6953	0.7036	0.7036	0.2998	2015/6/25
广发全指主要消费 ETF	0.9357	0.9357	0.9145	0.9145	0.8249	2015/7/1
广发中证医疗分级	0.9301	0.9301	0.9419	0.9419	4.5487	2015/7/23

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

11 月沪深两市持续上涨，覆盖两市的申万 A 指上涨 5.17%。指数方面，本期核心市场指数中，创业板指涨幅最大，上涨 7.84%；上证 180 表现最差，上涨 0.56%。

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	2312.97	2291.25	2592.19	2265.67	2336.29	1.01%	15948.26
上证 180	7685.71	7597.69	8484.93	7511.19	7728.44	0.56%	35552.48
深证成指	11546.05	11306.20	12970.47	11200.60	12037.86	4.26%	63602.95
深证 100P	3925.72	3859.10	4350.40	3817.15	4001.46	1.93%	22666.12
中小板指	7795.92	7623.20	8814.77	7562.59	8163.05	4.71%	14703.39
中小板 300	1623.52	1583.28	1862.38	1569.17	1727.24	6.39%	32140.49
创业板指	2478.28	2416.10	2915.95	2407.55	2672.58	7.84%	14359.83
沪深 300	3534.08	3489.23	3891.77	3452.62	3566.41	0.91%	58525.76

中证 500	7084.97	6936.37	7974.74	6860.44	7408.40	4.56%	45336.57
申万 A 指	3796.51	3723.05	4271.35	3689.15	3992.91	5.17%	211186.35

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	2107.12	2075.38	2289.38	2004.17	2082.51	-1.17%	3169.97
全指材料	3267.67	3201.10	3724.47	3172.76	3475.88	6.37%	25098.58
全指工业	4757.92	4672.71	5218.96	4573.42	4799.25	0.87%	43438.05
全指可选	6223.38	6102.45	6946.09	6050.06	6488.07	4.25%	27009.90
全指消费	8221.78	8101.73	8874.34	8046.68	8436.41	2.61%	8257.83
全指医药	10425.57	10217.76	11302.38	10067.33	10522.46	0.93%	9608.80
全指金融	5348.99	5282.52	6125.96	5238.10	5612.37	4.92%	26473.15
全指信息	7056.26	6861.35	8312.99	6826.28	7654.76	8.48%	33567.34
全指电信	6430.92	6243.58	7513.44	6111.97	6983.87	8.60%	5675.68
全指公用	3138.72	3094.08	3367.78	3029.69	3159.82	0.67%	5490.95
中证全指	5090.64	4999.05	5703.26	4948.39	5330.91	4.72%	208588.30

图 3 核心指数月度表现

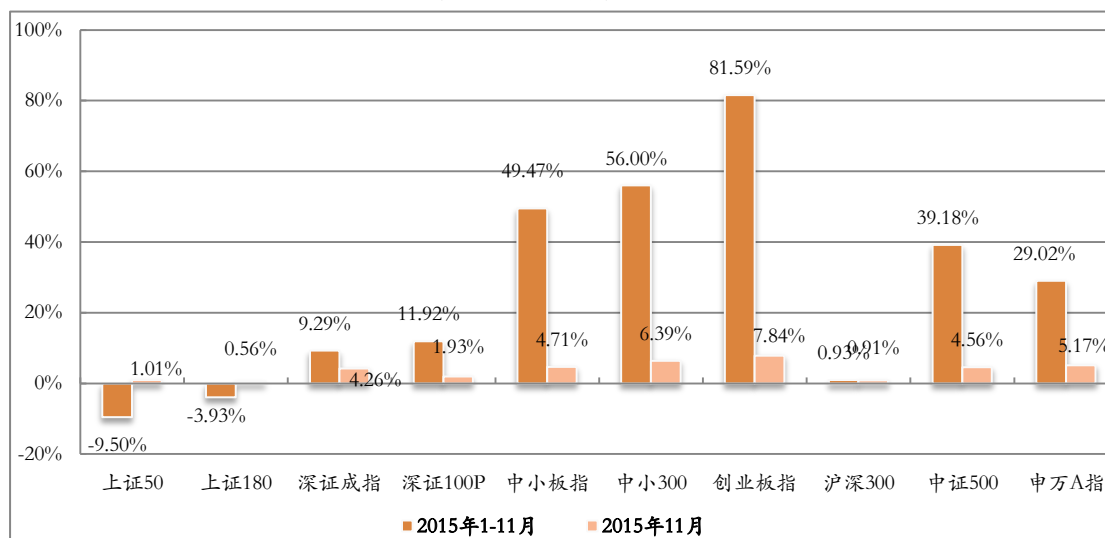


图 4 核心指数本月绝对收益

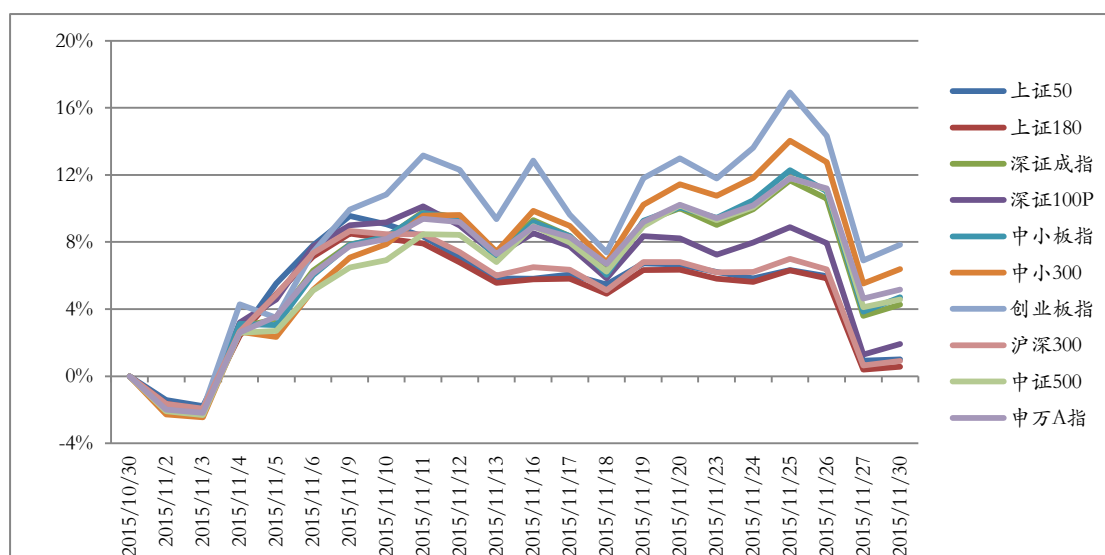
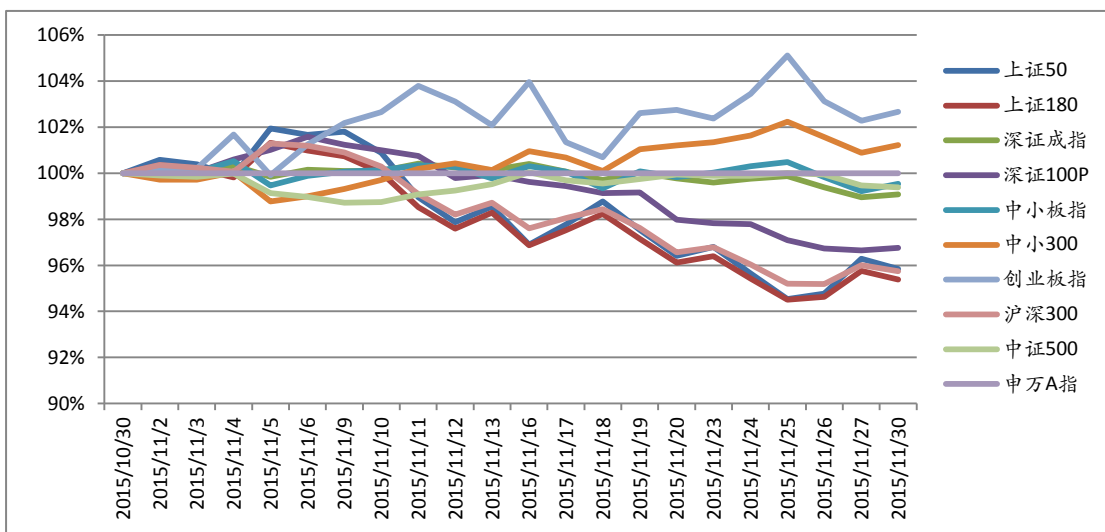


图 5 核心指数本月超额收益对比



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

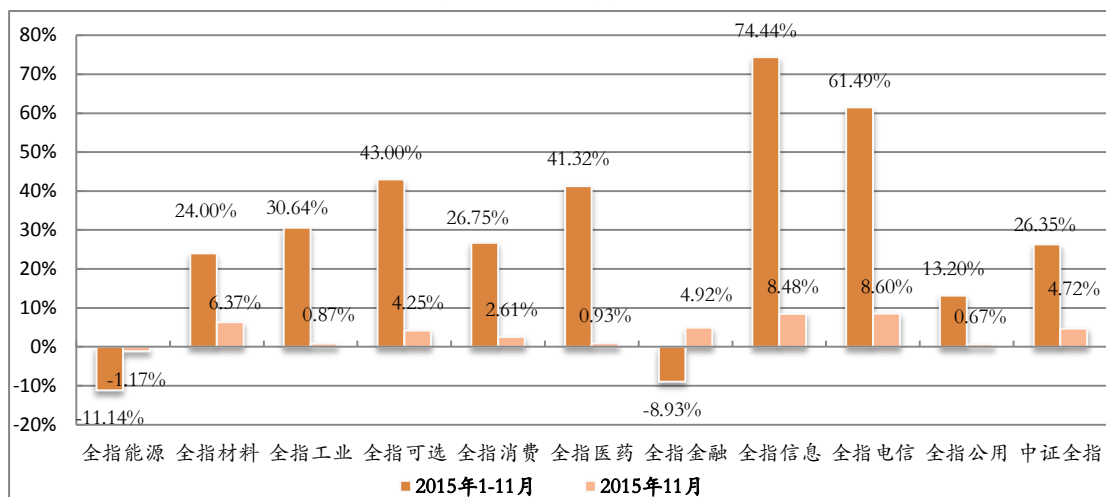


图 7 行业指数本月绝对收益

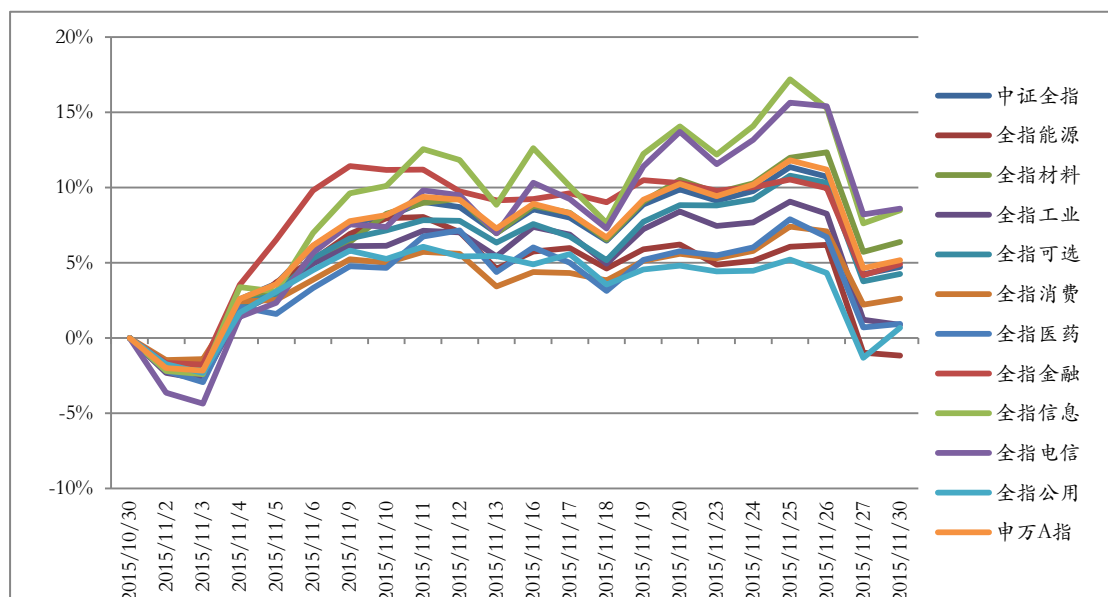
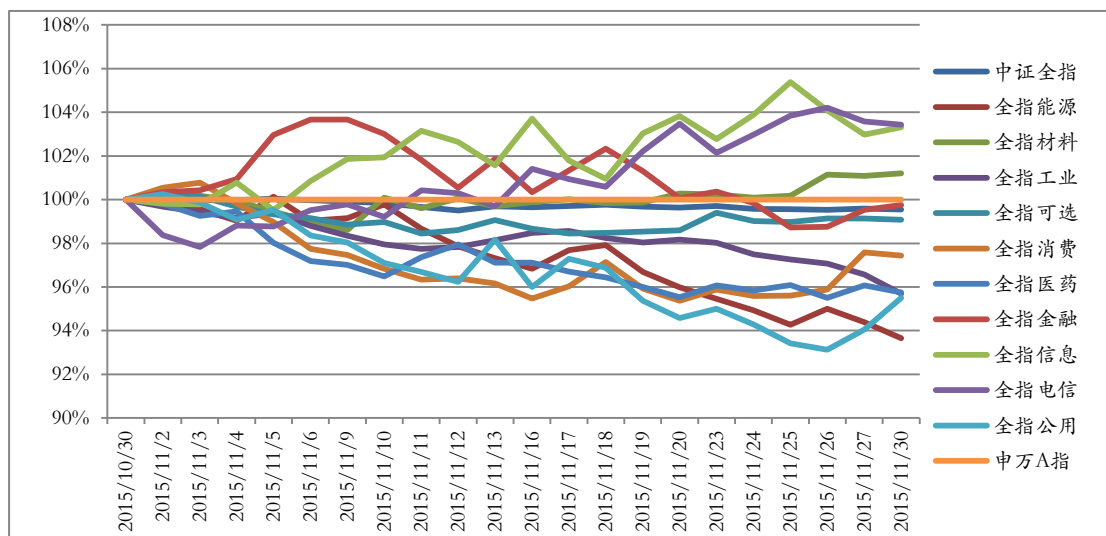


图 8 行业指数本月超额收益对比



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 11 月份核心指数的估值水平继续回升，市场平均动态（2016 年）市盈率为 17.07 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 9.67 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	16.76	9.88	9.67	1.17
上证 180	18.78	11.04	10.64	1.32
深证成指	57.17	30.83	27.39	3.42
深证 100	37.22	20.77	19.38	2.66
中小板指	67.11	36.33	32.58	4.92
中小 300	84.13	44.31	38.21	5.05
创业板指	165.29	68.96	56.20	9.53
沪深 300	21.27	12.39	11.89	1.49
中证 500	79.84	42.11	35.11	3.35
申万 A 指	33.28	19.23	17.07	2.16

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	39.78	29.14	23.65	1.03
全指材料	86.46	45.46	37.24	2.37
全指工业	62.83	31.70	27.01	2.73
全指可选	53.05	28.57	24.38	3.33
全指消费	51.18	30.06	25.93	3.74
全指医药	81.06	45.83	41.11	5.15
全指金融	14.30	8.55	8.24	1.26
全指信息	151.55	73.17	57.06	6.56
全指电信	111.30	51.82	44.99	2.28
全指公用	30.96	17.88	15.04	1.89
中证全指	32.36	18.67	16.63	2.09

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	33.80	0.93	24.75	9.29
600036	招商银行	17.20	-4.07	15.08	7.20
600016	民生银行	8.63	0.35	13.21	6.47
600000	浦发银行	18.65	13.79	32.96	5.30
601166	兴业银行	15.65	2.49	32.28	4.54
贡献前 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	18.65	13.79	32.96	14.99
600030	中信证券	17.63	11.09	118.19	8.23
601901	方正证券	9.48	28.63	164.26	5.15
600518	康美药业	18.61	11.77	46.71	3.59
601601	中国太保	26.46	7.30	32.01	3.36
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
601901	方正证券	9.48	28.63	164.26	5.15
600000	浦发银行	18.65	13.79	32.96	14.99
601998	中信银行	7.26	13.44	91.69	1.64
600518	康美药业	18.61	11.77	46.71	3.59
600030	中信证券	17.63	11.09	118.19	8.23
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
601186	中国铁建	13.73	-10.20	45.37	-3.20
600406	国电南瑞	15.41	-9.30	88.17	-1.36
601390	中国中铁	11.18	-9.18	52.31	-3.74
601989	中国重工	10.06	-9.04	86.91	-5.46
600583	海油工程	9.05	-8.86	49.24	-1.16

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	33.80	0.93	24.75	5.69
600036	招商银行	17.20	-4.07	15.08	4.41
600016	民生银行	8.63	0.35	13.21	3.96
600000	浦发银行	18.65	13.79	32.96	3.24
601166	兴业银行	15.65	2.49	32.28	2.78
贡献前 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	18.65	13.79	32.96	30.42
600030	中信证券	17.63	11.09	118.19	16.66
601901	方正证券	9.48	28.63	164.26	10.42
600352	浙江龙盛	13.41	28.82	88.38	8.22
601377	兴业证券	10.63	17.33	187.97	7.89
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
600516	方大炭素	14.41	33.55	234.70	4.50
600718	东软集团	23.57	31.09	99.50	5.76
600352	浙江龙盛	13.41	28.82	88.38	8.22
601901	方正证券	9.48	28.63	164.26	10.42
600873	梅花生物	8.77	22.32	128.46	3.61
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
601106	中国一重	8.35	-13.38	107.62	-4.11
600415	小商品城	9.13	-12.04	119.38	-4.13
601933	永辉超市	9.69	-11.51	72.83	-3.05
600804	鹏博士	22.85	-11.33	73.94	-3.92
600597	光明乳业	15.03	-11.17	55.94	-1.40

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	15.07	10.24	22.43	2.24
000651	格力电器	18.33	5.65	36.80	1.46
000001	平安银行	11.74	3.35	31.82	1.29
000725	京东方 A	2.93	-1.34	67.29	1.20
300059	东方财富	56.71	6.16	200.33	1.09
贡献前 5 名样本股					
代码	简称	收盘	涨跌幅%	换手率%	贡献点数
002673	西部证券	35.84	67.63	297.38	29.91
000002	万科 A	15.07	10.24	22.43	25.03
002466	天齐锂业	155.70	91.32	220.45	22.57
300113	顺网科技	95.70	94.43	155.46	14.91
002049	同方国芯	60.97	86.51	144.49	14.44
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
300113	顺网科技	95.70	94.43	155.46	14.91
002466	天齐锂业	155.70	91.32	220.45	22.57
002416	爱施德	20.06	89.42	362.44	4.20
002049	同方国芯	60.97	86.51	144.49	14.44
002673	西部证券	35.84	67.63	297.38	29.91
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
000917	电广传媒	26.18	-38.87	94.87	-39.13
002577	雷柏科技	50.60	-37.22	125.63	-6.04
000812	陕西金叶	13.90	-27.03	57.56	-3.98
300197	铁汉生态	17.82	-25.81	134.62	-4.09
002570	贝因美	13.95	-24.84	224.86	-5.09

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	15.07	10.24	22.43	5.15
000651	格力电器	18.33	5.65	36.80	3.36
000001	平安银行	11.74	3.35	31.82	2.96
000725	京东方 A	2.93	-1.34	67.29	2.76
300059	东方财富	56.71	6.16	200.33	2.52
贡献前 5 名样本股					
代码	简称	收盘	涨跌幅%	换手率%	贡献点数
002673	西部证券	35.84	67.63	297.38	22.87
000002	万科 A	15.07	10.24	22.43	19.15
000793	华闻传媒	15.45	36.73	138.43	9.91
000776	广发证券	17.60	12.39	81.92	9.02
000009	中国宝安	20.00	25.00	234.16	8.25
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
002673	西部证券	35.84	67.63	297.38	22.87
000793	华闻传媒	15.45	36.73	138.43	9.91
000009	中国宝安	20.00	25.00	234.16	8.25
000686	东北证券	17.36	24.00	266.72	6.31
002241	歌尔声学	31.68	23.80	81.12	7.72
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
000917	电广传媒	26.18	-38.87	94.87	-29.93
002570	贝因美	13.95	-24.84	224.86	-3.90
002024	苏宁云商	13.73	-15.56	155.16	-16.44
000768	中航飞机	24.75	-15.18	113.18	-7.99
000800	一汽轿车	15.01	-13.24	88.93	-2.97

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	13.73	-15.56	155.16	4.06
002415	海康威视	33.59	-3.00	53.36	3.22
002450	康得新	35.35	-1.12	51.30	3.21
002673	西部证券	35.84	67.63	297.38	2.57
002594	比亚迪	62.68	-6.59	102.21	2.38
贡献前 5 名样本股					
代码	简称	收盘	涨跌幅%	换手率%	贡献点数
002673	西部证券	35.84	67.63	297.38	84.79
002049	同方国芯	60.97	86.51	144.49	40.93
002241	歌尔声学	31.68	23.80	81.12	28.62
002405	四维图新	40.80	20.11	137.58	20.73
002092	中泰化学	11.72	40.02	33.33	19.98
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
002049	同方国芯	60.97	86.51	144.49	40.93
002673	西部证券	35.84	67.63	297.38	84.79
002273	水晶光电	35.88	53.20	316.73	19.82
002092	中泰化学	11.72	40.02	33.33	19.98
002005	德豪润达	9.59	38.38	87.93	15.33
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
002570	贝因美	13.95	-24.84	224.86	-14.46
002106	莱宝高科	13.33	-18.82	106.13	-9.40
002024	苏宁云商	13.73	-15.56	155.16	-61.03
002470	金正大	18.70	-11.08	71.74	-7.33
002251	步步高	16.06	-11.07	138.79	-3.23

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	13.73	-15.56	155.16	2.18
002415	海康威视	33.59	-3.00	53.36	1.73
002450	康得新	35.35	-1.12	51.30	1.72
002673	西部证券	35.84	67.63	297.38	1.38
002594	比亚迪	62.68	-6.59	102.21	1.28
贡献前 5 名样本股					
代码	简称	收盘	涨跌幅%	换手率%	贡献点数
002673	西部证券	35.84	67.63	297.38	9.63
002466	天齐锂业	155.70	91.32	220.45	7.27
002049	同方国芯	60.97	86.51	144.49	4.65
002681	奋达科技	42.55	36.82	244.35	3.31
002241	歌尔声学	31.68	23.80	81.12	3.25
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
002466	天齐锂业	155.70	91.32	220.45	7.27
002416	爱施德	20.06	89.42	362.44	1.36
002049	同方国芯	60.97	86.51	144.49	4.65
002673	西部证券	35.84	67.63	297.38	9.63
002288	超华科技	13.51	65.36	349.34	2.07
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
002577	雷柏科技	50.60	-37.22	125.63	-1.95
002002	鸿达兴业	25.36	-35.47	254.75	-3.44
002570	贝因美	13.95	-24.84	224.86	-1.64
002571	德力股份	15.98	-22.05	390.66	-0.66
002106	莱宝高科	13.33	-18.82	106.13	-1.07

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	56.71	6.16	200.33	5.78
300104	乐视网	48.50	1.36	127.79	4.28
300024	机器人	73.88	-4.37	131.15	3.26
300027	华谊兄弟	38.06	3.14	139.28	2.89
300017	网宿科技	62.00	2.89	91.58	2.60
贡献前 5 名样本股					
代码	简称	收盘	涨跌幅%	换手率%	贡献点数
300113	顺网科技	95.70	94.43	155.46	17.59
300059	东方财富	56.71	6.16	200.33	9.19
300156	神雾环保	52.00	38.48	108.19	9.10
300070	碧水源	50.02	14.49	34.36	8.81
300088	长信科技	14.43	43.15	170.91	8.62
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
300113	顺网科技	95.70	94.43	155.46	17.59
300228	富瑞特装	31.70	66.84	84.30	5.74
300288	朗玛信息	41.58	46.41	0.17	3.85
300157	恒泰艾普	12.56	43.87	113.96	4.53
300088	长信科技	14.43	43.15	170.91	8.62
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
300142	沃森生物	14.52	-10.54	168.65	-4.11
300352	北信源	48.07	-9.30	191.68	-1.59
300216	千山药机	43.50	-8.61	96.18	-2.51
300226	上海钢联	55.38	-7.70	287.09	-1.20
300033	同花顺	80.99	-6.53	303.13	-2.62

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	33.80	0.93	24.75	3.96
600036	招商银行	17.20	-4.07	15.08	3.07
600016	民生银行	8.63	0.35	13.21	2.76
600000	浦发银行	18.65	13.79	32.96	2.26
601166	兴业银行	15.65	2.49	32.28	1.93
贡献前 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	18.65	13.79	32.96	9.74
002673	西部证券	35.84	67.63	297.38	6.22
600030	中信证券	17.63	11.09	118.19	5.33
000002	万科 A	15.07	10.24	22.43	5.23
601901	方正证券	9.48	28.63	164.26	3.34
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
002673	西部证券	35.84	67.63	297.38	6.22
600783	鲁信创投	39.22	54.96	342.34	1.63
000793	华闻传媒	15.45	36.73	138.43	2.30
600516	方大炭素	14.41	33.55	234.70	1.44
600718	东软集团	23.57	31.09	99.50	1.85
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
000917	电广传媒	26.18	-38.87	94.87	-7.24
002570	贝因美	13.95	-24.84	224.86	-0.93
002024	苏宁云商	13.73	-15.56	155.16	-4.30
000768	中航飞机	24.75	-15.18	113.18	-2.26
601106	中国一重	8.35	-13.38	107.62	-1.28

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	44.06	-1.63	141.98	0.68
600978	宜华木业	22.33	0.00	0.00	0.66
002466	天齐锂业	155.70	91.32	220.45	0.60
002405	四维图新	40.80	20.11	137.58	0.56
600446	金证股份	46.90	4.22	351.40	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
002466	天齐锂业	155.70	91.32	220.45	21.16
002049	同方国芯	60.97	86.51	144.49	12.71
600584	长电科技	22.02	48.58	126.97	10.67
600122	宏图高科	17.30	52.42	148.89	9.93
002161	远望谷	24.10	54.49	323.71	9.21
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
002466	天齐锂业	155.70	91.32	220.45	21.16
002049	同方国芯	60.97	86.51	144.49	12.71
002489	浙江永强	11.98	61.67	459.21	9.16
002161	远望谷	24.10	54.49	323.71	9.21
002477	雏鹰农牧	16.18	54.10	118.05	4.38
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
002106	莱宝高科	13.33	-18.82	106.13	-2.80
600280	中央商场	10.79	-17.63	166.80	-1.48
000582	北部湾港	19.93	-17.51	205.85	-0.68
600389	江山股份	23.45	-16.79	76.70	-0.87
600312	平高电气	18.39	-16.71	93.23	-4.63

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	33.80	0.93	23.53	1.69
600016	民生银行	8.63	0.35	12.62	1.07
600036	招商银行	17.20	-4.07	14.33	0.83
601166	兴业银行	15.65	2.49	30.88	0.74
600030	中信证券	17.63	11.09	111.80	0.72
贡献前 5 名样本股					
代码	简称	收盘	涨跌幅%	换手率%	贡献点数
600030	中信证券	17.63	11.09	111.80	6.11
600000	浦发银行	18.65	13.79	31.47	4.88
002673	西部证券	35.84	67.63	284.29	3.20
601318	中国平安	33.80	0.93	23.53	3.01
601901	方正证券	9.48	28.63	157.79	2.51
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
002558	世纪游轮	120.20	279.78	2.12	0.27
600053	中江地产	45.38	245.36	3.77	0.71
002668	奥马电器	104.98	170.99	201.62	1.36
300441	鲍斯股份	61.01	159.40	103.66	0.28
002751	易尚展示	145.00	156.18	416.52	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
601003	柳钢股份	4.22	-41.14	117.79	-0.24
600555	九龙山	9.13	-39.58	99.45	-0.68
000917	电广传媒	26.18	-38.87	87.49	-2.98
002577	雷柏科技	50.60	-37.22	114.72	-0.46
002002	鸿达兴业	25.36	-35.47	246.76	-0.85

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。