

广发基金指数月报

(2015年11月2日—2015年11月30日)

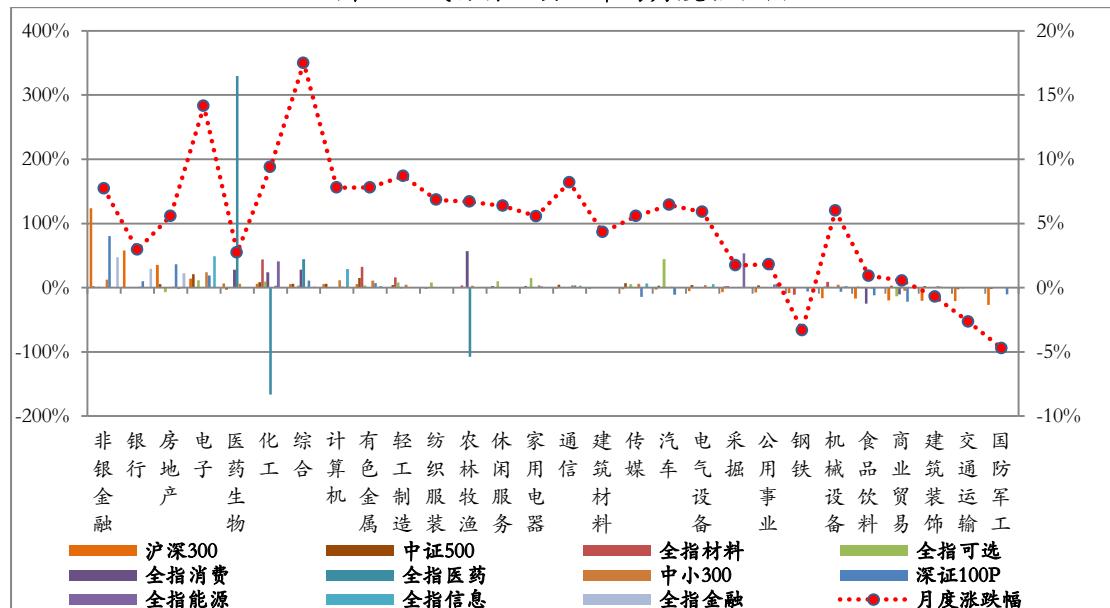
广发基金数量投资部

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%。

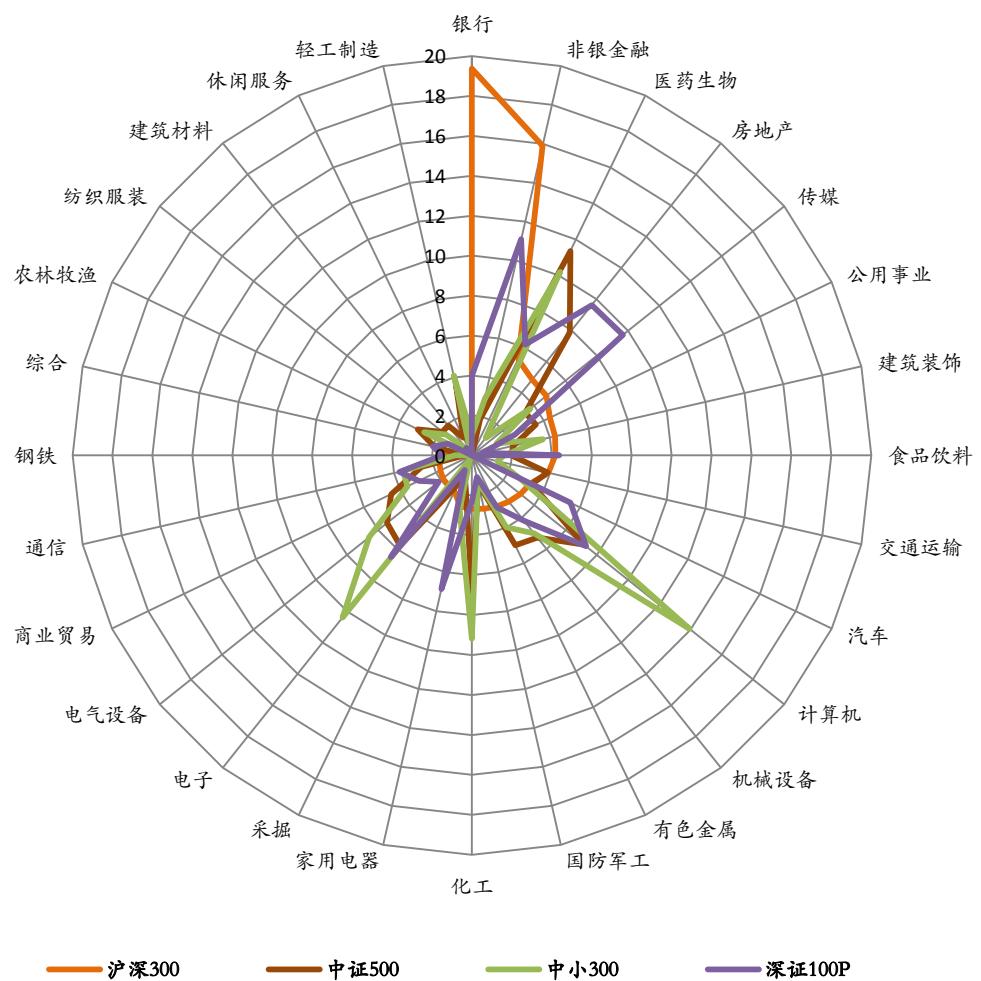
图1 成份行业贡献率与月度涨跌幅

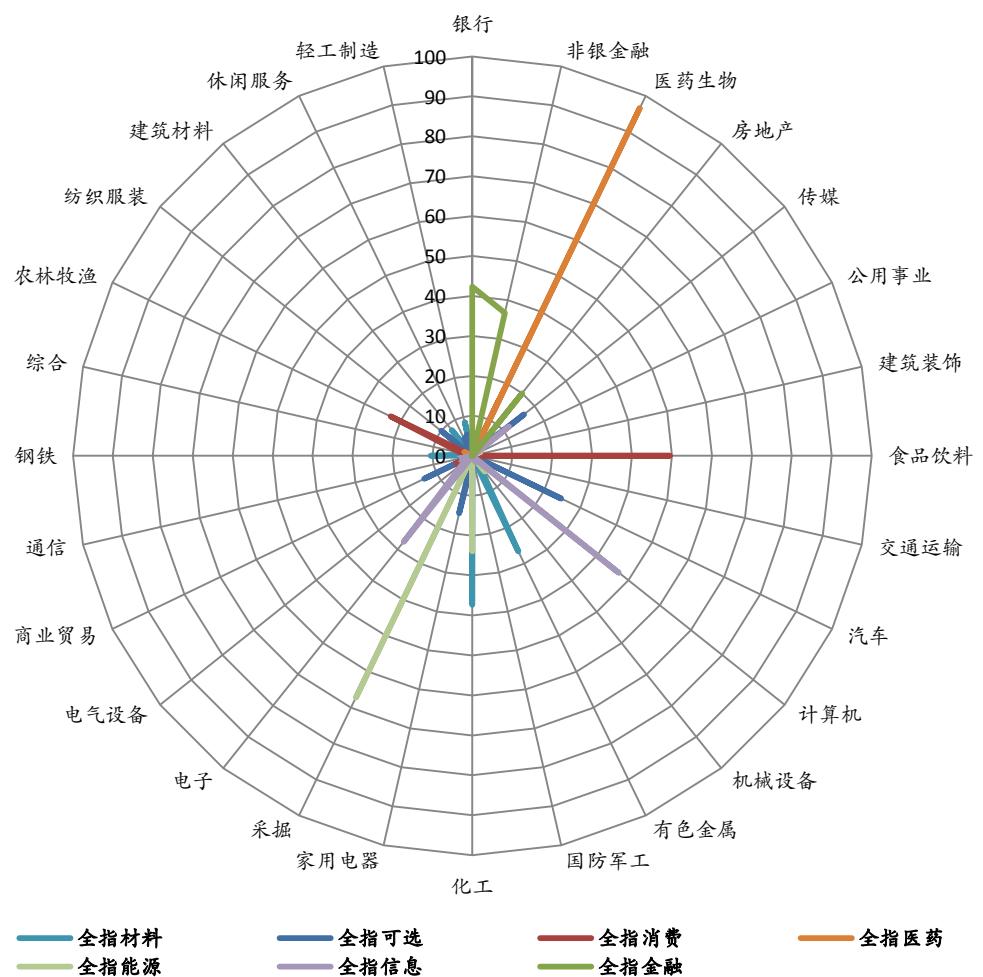


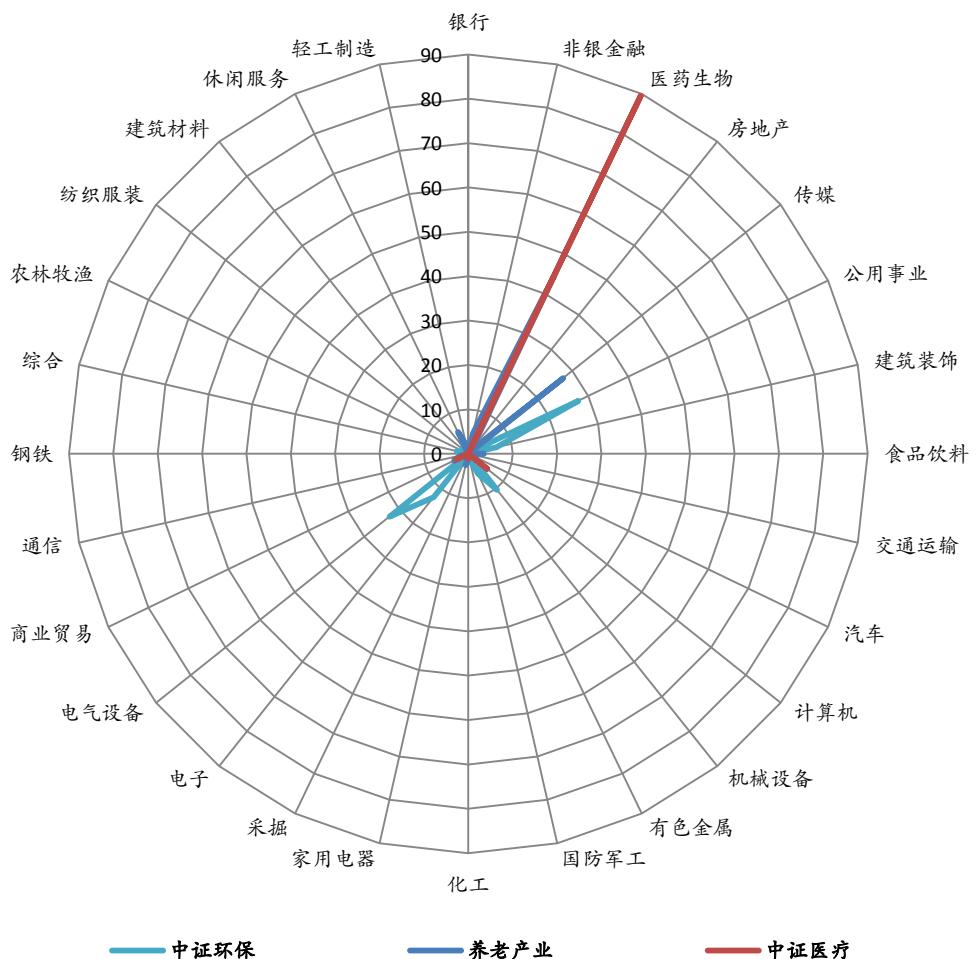
以巨潮数据库提供的权重数据计算，本月末银行业在沪深300指数中所占比重居首，为19.4%。医药生物、房地产和计算机行业在中证500指数中权重居前，依次为11.36%、7.87%和7.17%。计算机、电子和医药生物行业在中小300指数中权重居前，分别为13.93%、10.40%和10.19%。非银金融、传媒和房地产在深

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

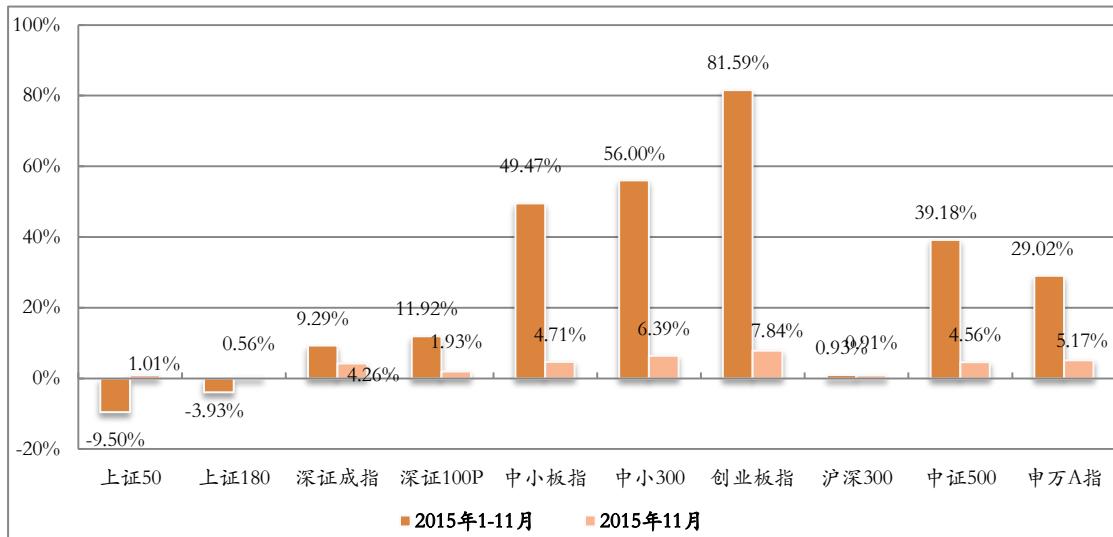


图4 核心指数本月绝对收益

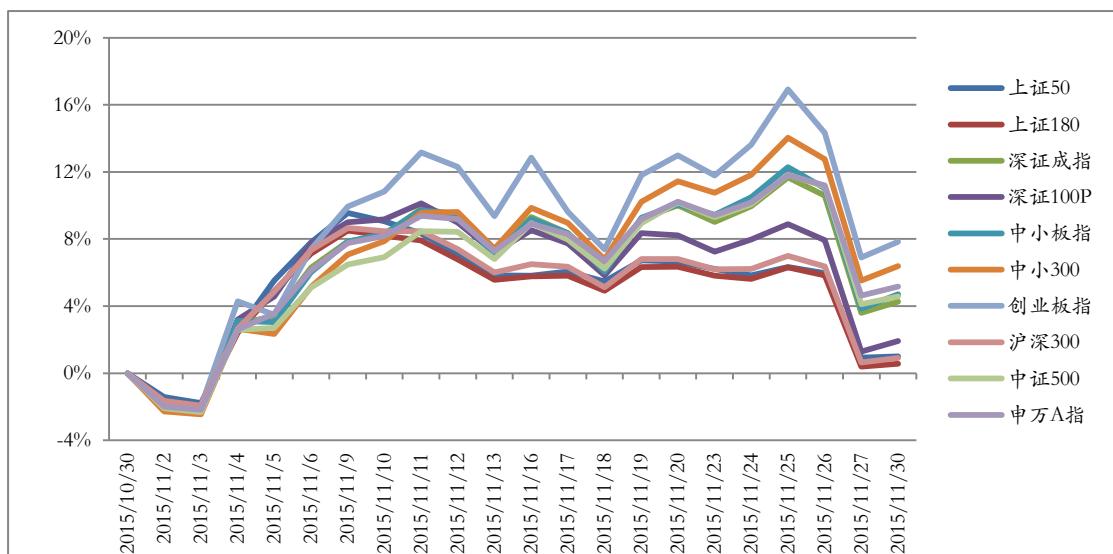
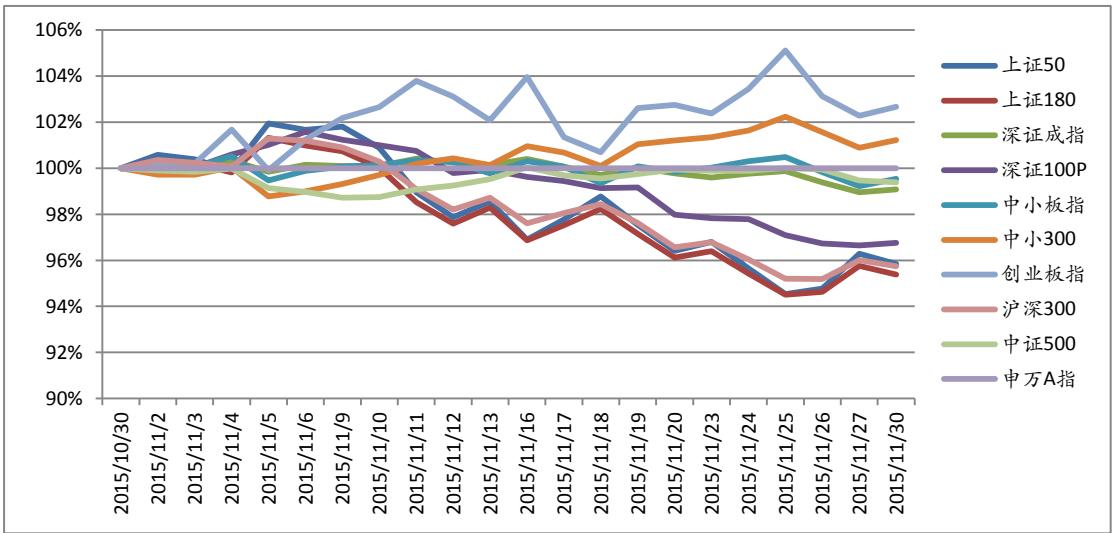


图5 核心指数本月超额收益对比



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

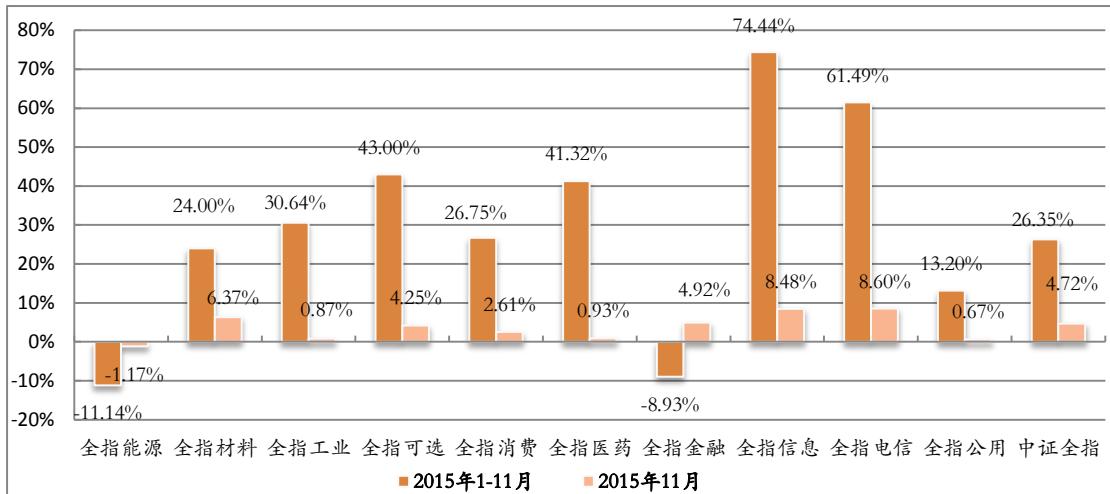


图 7 行业指数本月绝对收益

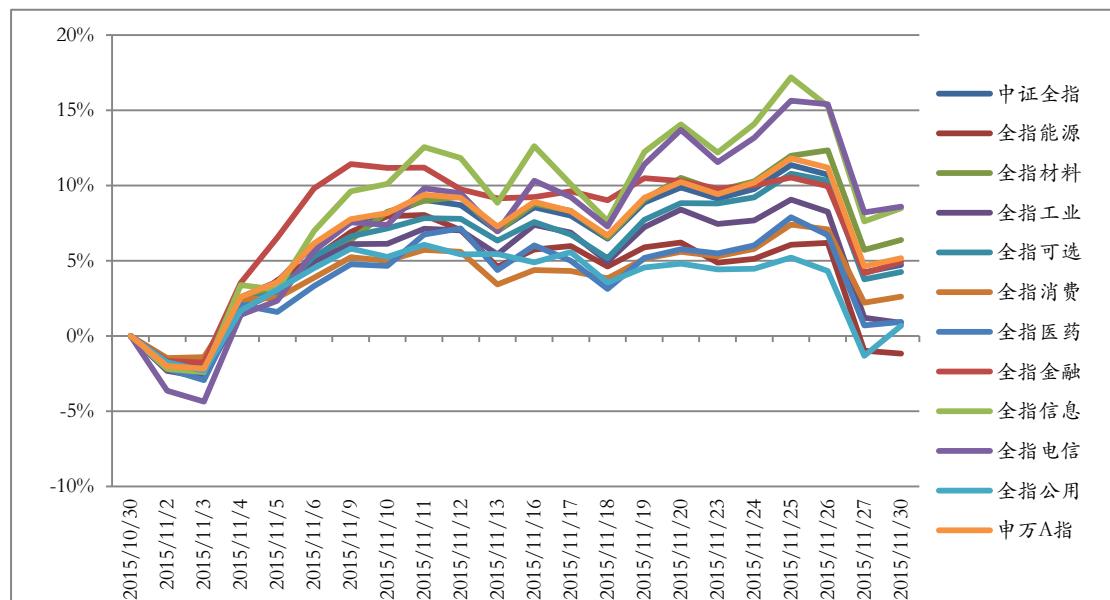
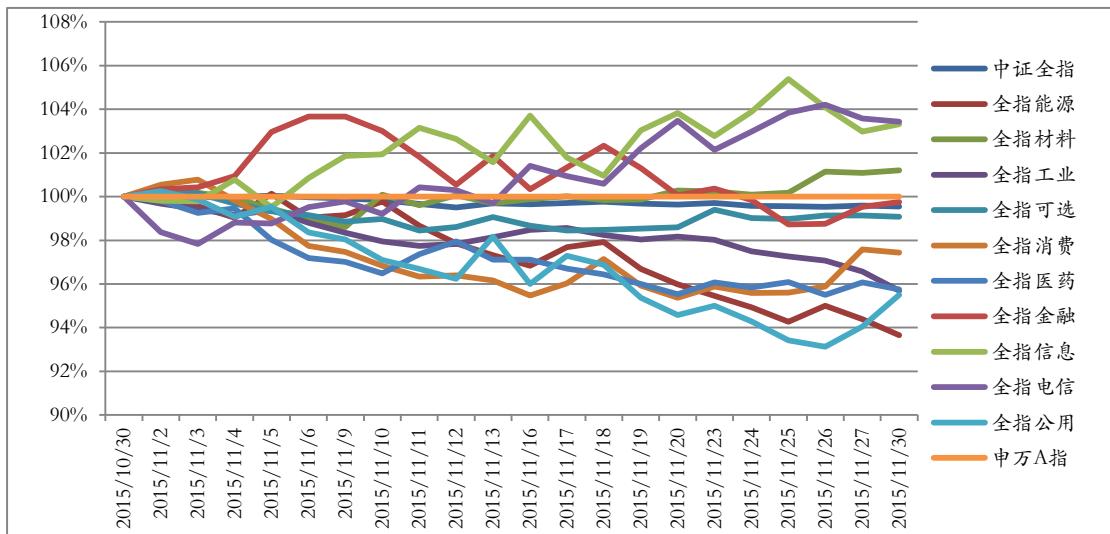


图 8 行业指数本月超额收益对比



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

- 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。