

# 广发基金指数月报

(2015年12月1日—2015年12月31日)

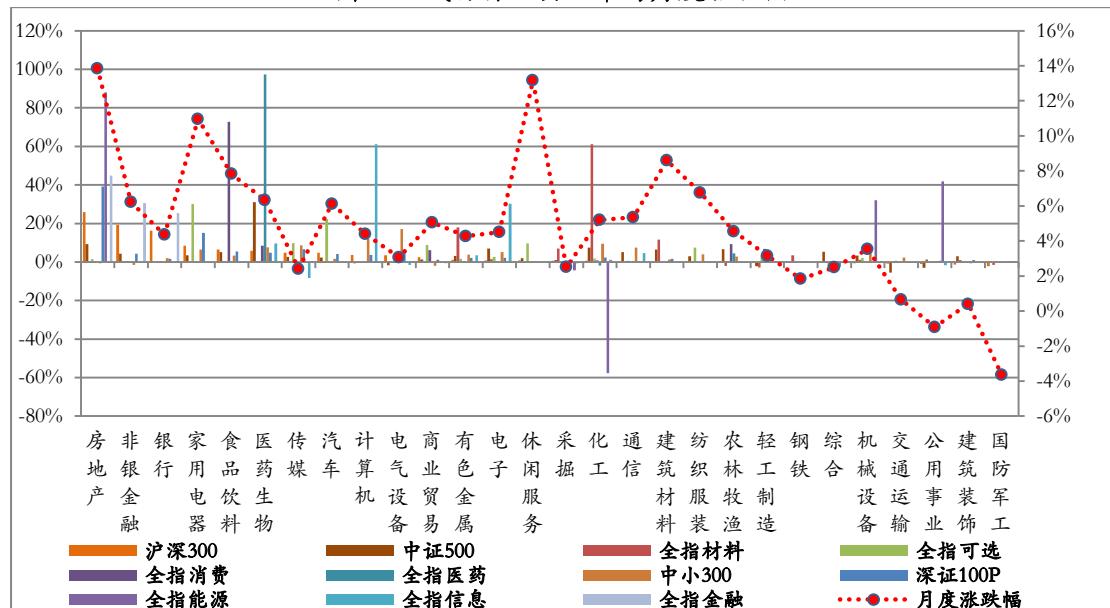
广发基金数量投资部

## 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

本月市场持续上行，申万28个一级行业涨多跌少，房地产、休闲服务和家用电器行业涨幅均超10%，国防军工和公用事业行业小幅下跌。从各指数成份股的行业贡献率来看，房地产行业对沪深300指数影响最大，贡献率为25.92%；医药生物行业对中证500指数贡献最大，贡献率为31.02%；电气设备行业对中小300指数贡献居首，贡献率为17.01%；房地产行业对深证100指数贡献最大，贡献率为39.14%。

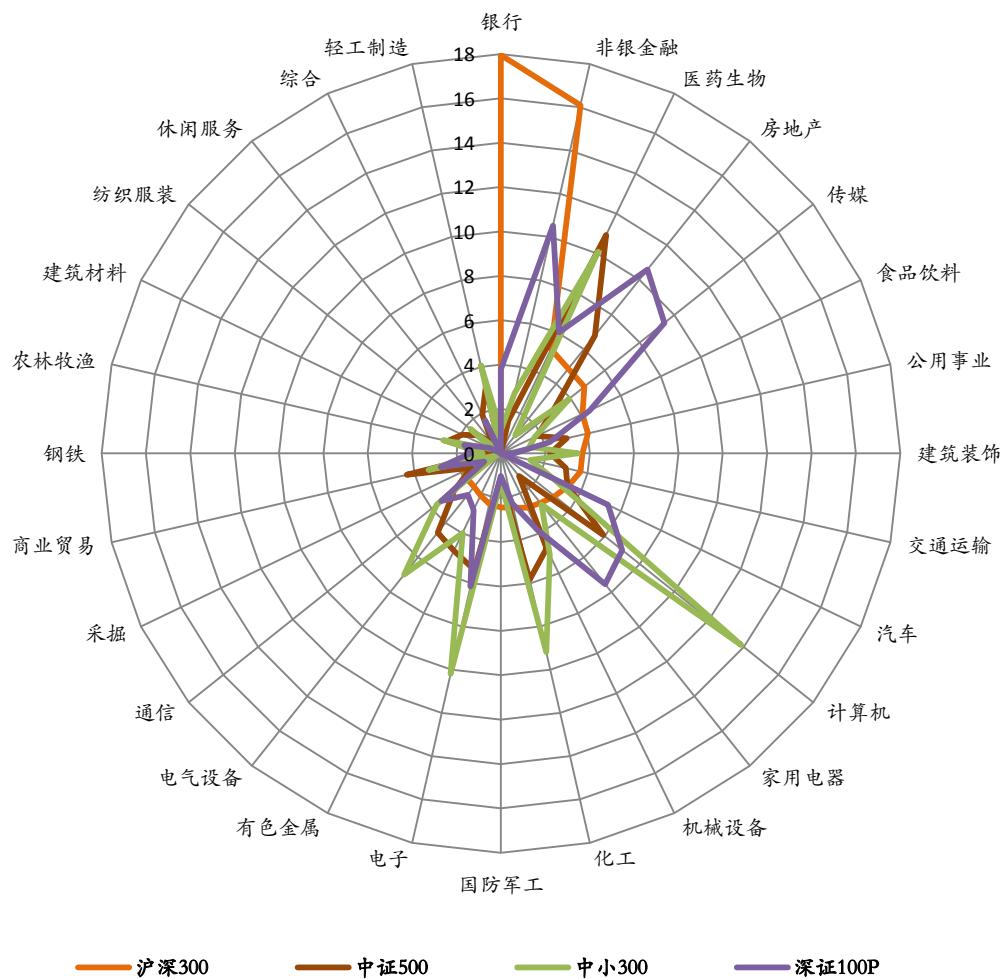
图1 成份行业贡献率与月度涨跌幅

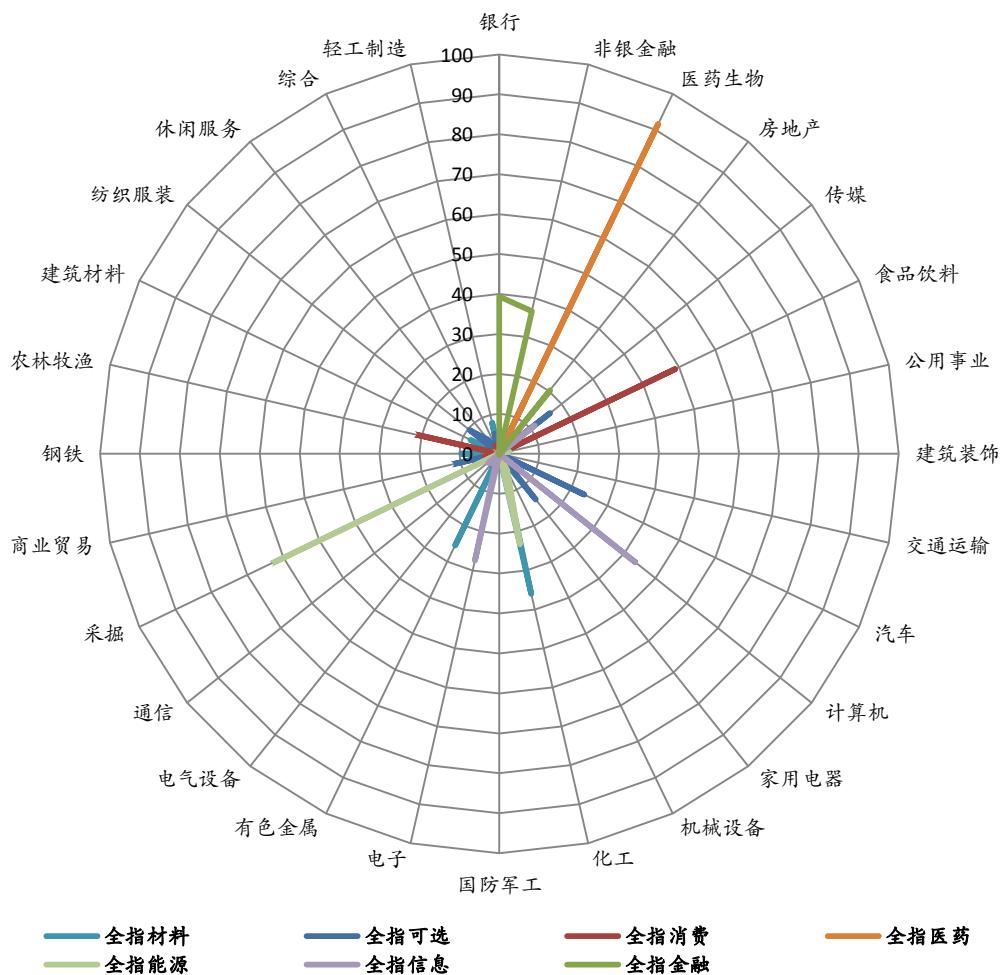


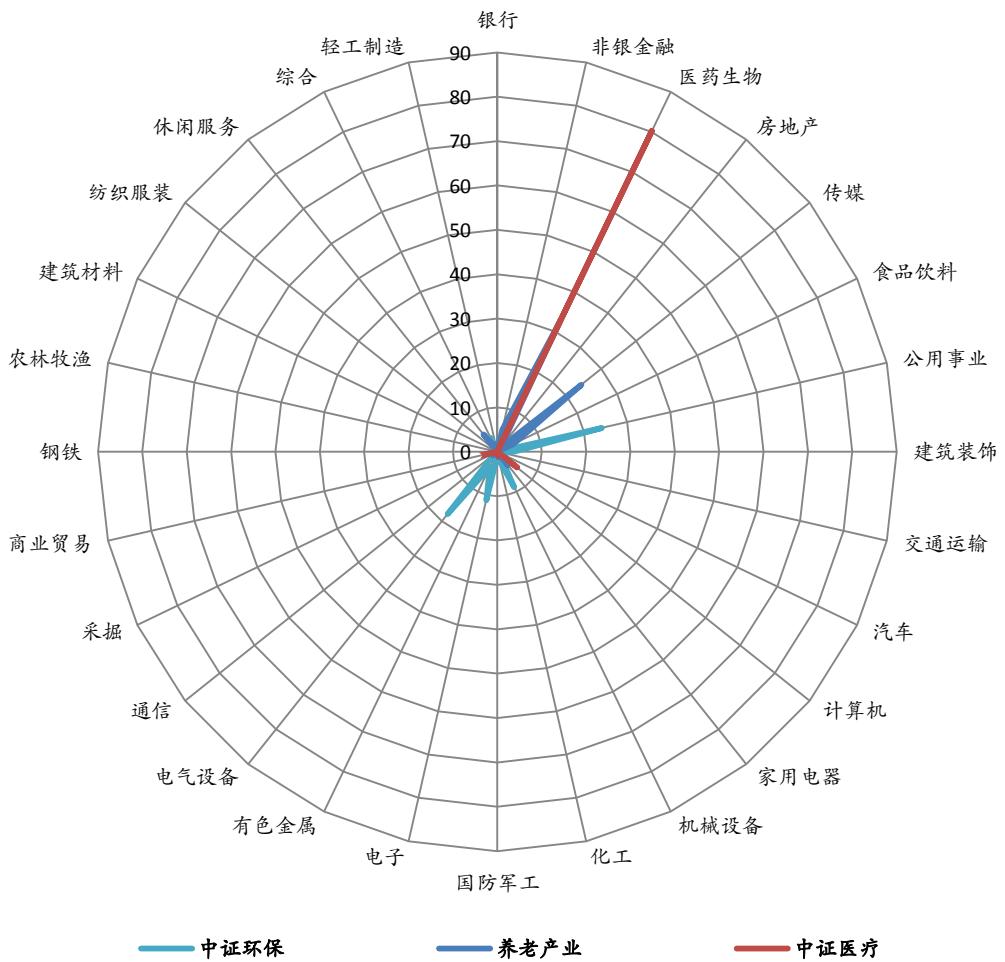
以巨潮数据库提供的权重数据计算，本月末银行业在沪深300指数中所占比重居首，为17.95%。医药生物、房地产和计算机行业在中证500指数中权重居前，依次为10.92%、6.79%和5.89%。计算机、电子和医药生物行业在中小300指数中权重居前，分别为13.85%、10.19%和10.09%。房地产、非银金融和传媒

行业在深证 100 指数中权重位列前三，依次为 10.60%、10.53% 和 9.42%。

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 0.496%。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 的年化跟踪误差最大值为 1.43%，跟踪效果较好。

表 1 基金净值与跟踪误差

基金简称	2015 年 12 月		2015 年 11 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	1.6440	1.9340	1.5750	1.8650	0.6768	2008/12/30
广发中证 500ETF 联接	1.5691	1.5691	1.5316	1.5316	0.6258	2009/11/26

广发中小板 300ETF	1.7397	1.5806	1.6710	1.5182	0.4961	2011/6/3
广发中小板 300 联接	1.4370	1.4370	1.3827	1.3827	0.4679	2011/6/9
广发深证 100 分级	1.1871	1.2750	1.1007	1.1886	0.9093	2012/5/7
广发中证 500ETF	2.0728	2.0728	2.0213	2.0213	0.6650	2013/4/11
广发全指可选消费 ETF	1.8387	1.8387	1.7248	1.7248	0.6363	2014/6/3
广发全指医药卫生 ETF	1.4724	1.4724	1.3861	1.3861	0.3548	2014/12/1
广发全指信息技术 ETF	1.4410	1.4410	1.3883	1.3883	0.5933	2015/1/8
广发中证养老产业	1.1334	1.1334	1.0817	1.0817	1.2898	2015/2/13
广发全指金融地产 ETF	0.8548	0.8548	0.7993	0.7993	0.5346	2015/3/23
广发中证环保产业	0.8926	0.8926	0.8779	0.8779	1.4253	2015/3/25
广发全指原材料 ETF	0.9160	0.9160	0.8764	0.8764	0.6356	2015/6/25
广发全指能源 ETF	0.7029	0.7029	0.6953	0.6953	0.4028	2015/6/25
广发全指主要消费 ETF	0.9892	0.9892	0.9357	0.9357	0.4113	2015/7/1
广发中证医疗分级	0.9129	0.9249	0.9301	0.9301	2.6198	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

12 月沪深两市持续上行，覆盖两市的申万 A 指上涨 4.85%。指数方面，本期核心市场指数中，深证成指涨幅最大，上涨 5.21%；创业板指表现最差，上涨 1.55%。

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	2336.29	2334.14	2550.90	2314.79	2420.80	3.62%	11756.05
上证 180	7728.44	7721.97	8416.18	7660.42	7995.77	3.46%	27339.43
深证成指	12037.86	12022.84	13187.05	11830.99	12664.89	5.21%	50780.92
深证 100P	4001.46	3993.18	4591.42	3962.34	4354.86	8.83%	18718.97
中小板指	8163.05	8147.43	8679.56	7918.33	8393.83	2.83%	11528.80
中小板 300	1727.24	1723.03	1845.31	1659.90	1797.90	4.09%	26562.28

创业板指	2672.58	2669.30	2850.69	2525.34	2714.05	1.55%	10609.55
沪深 300	3566.41	3562.32	3926.69	3536.12	3731.00	4.62%	45350.81
中证 500	7408.40	7403.94	7881.29	7201.66	7617.69	2.83%	34407.83
申万 A 指	3992.91	3988.75	4328.62	3916.57	4186.66	4.85%	180992.32

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	2082.51	2082.24	2178.10	2003.83	2106.32	1.14%	2285.97
全指材料	3475.88	3472.23	3746.35	3396.14	3629.44	4.42%	22271.32
全指工业	4799.25	4796.93	5037.65	4631.19	4876.94	1.62%	32040.68
全指可选	6488.07	6485.40	7150.48	6371.89	6924.08	6.72%	23333.93
全指消费	8436.41	8424.79	9295.05	8325.05	8937.25	5.94%	8069.78
全指医药	10522.46	10537.49	11662.03	10347.95	11200.78	6.45%	8230.40
全指金融	5612.37	5601.23	6403.56	5549.84	6008.03	7.05%	22549.65
全指信息	7654.76	7633.31	8194.01	7206.16	7944.96	3.79%	27224.13
全指电信	6983.87	6961.97	7564.51	6621.43	7334.62	5.02%	4694.70
全指公用	3159.82	3162.91	3254.67	3032.41	3123.44	-1.15%	3464.60
中证全指	<b>5330.91</b>	<b>5325.23</b>	<b>5788.64</b>	<b>5244.84</b>	<b>5592.64</b>	<b>4.91%</b>	<b>175448.52</b>

图3 核心指数月度表现

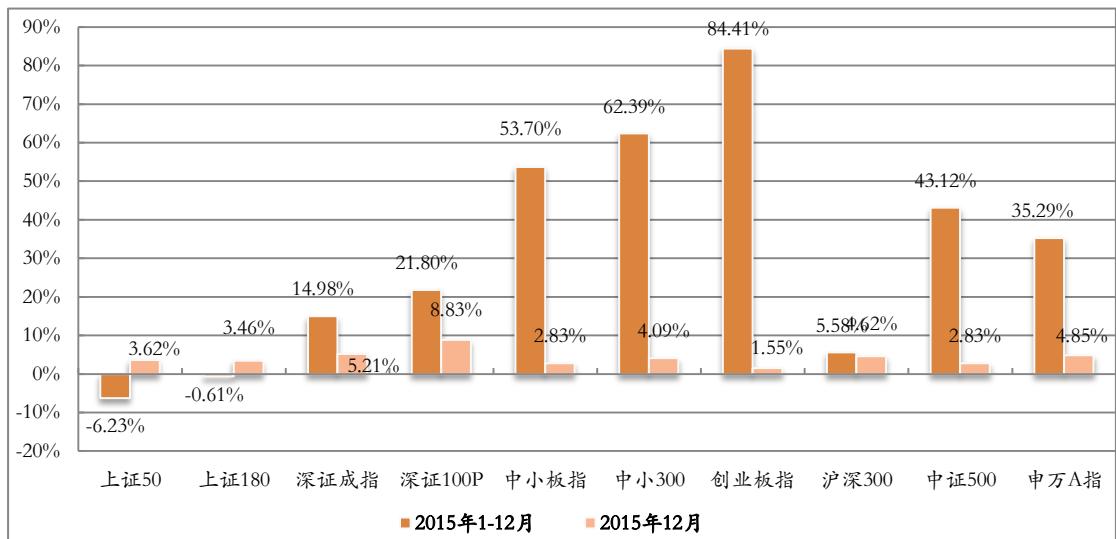


图4 核心指数本月绝对收益

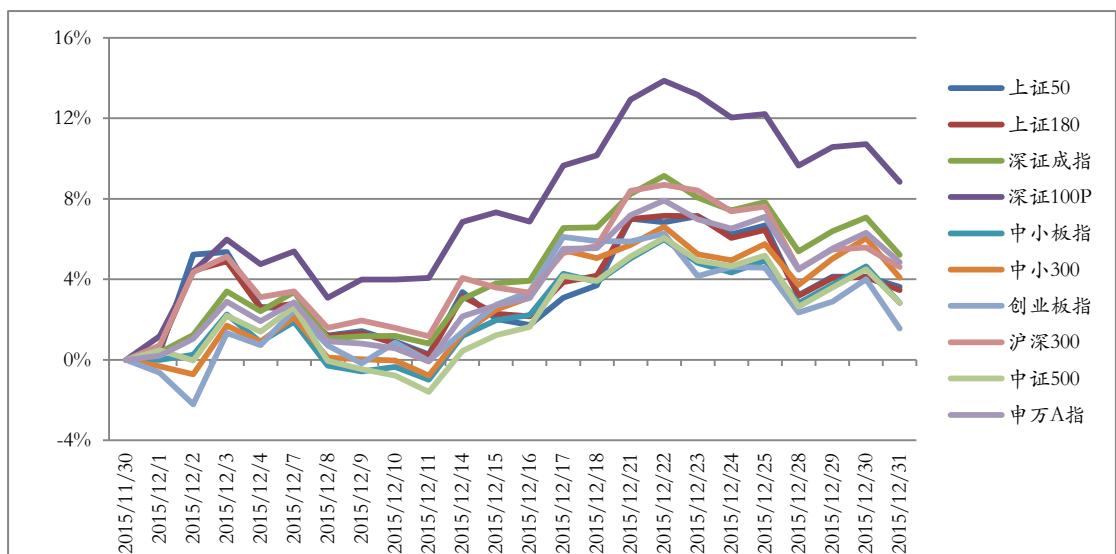
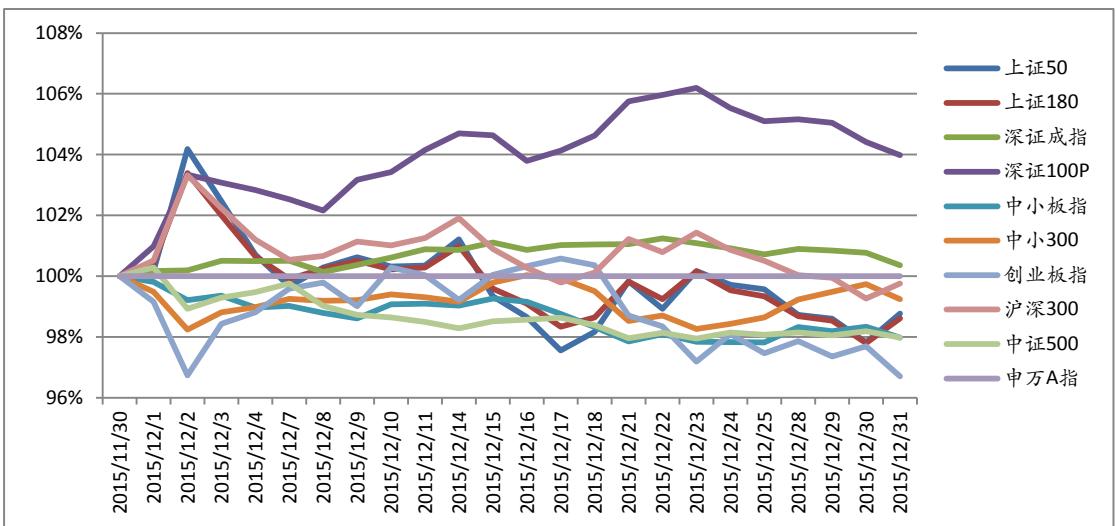


图5 核心指数本月超额收益对比



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

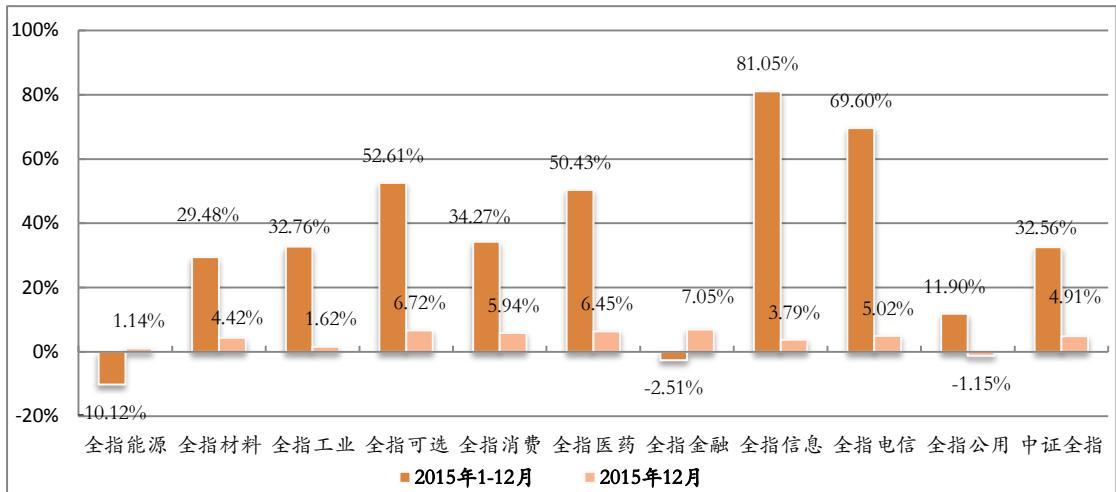


图 7 行业指数本月绝对收益

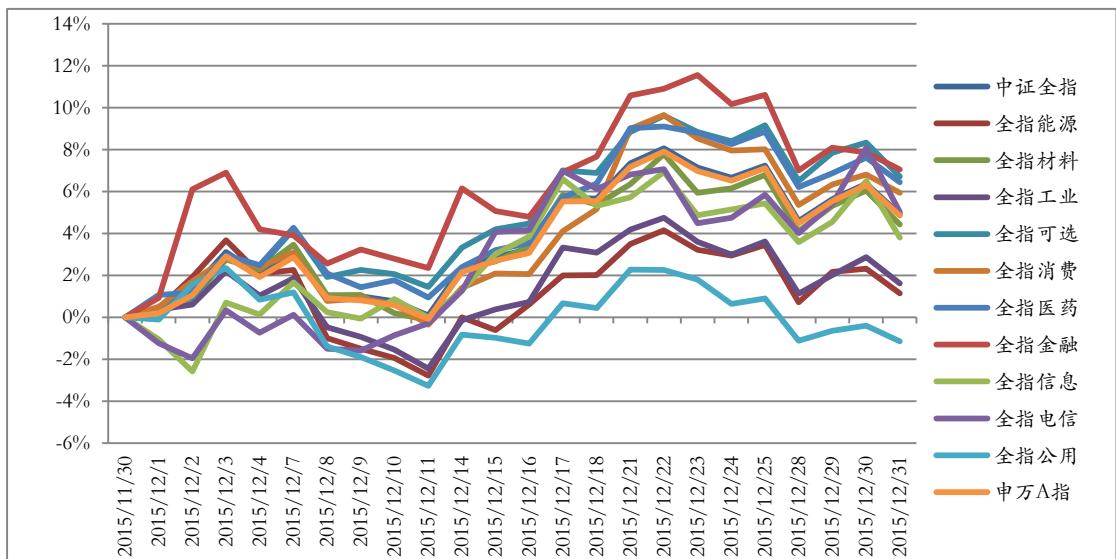
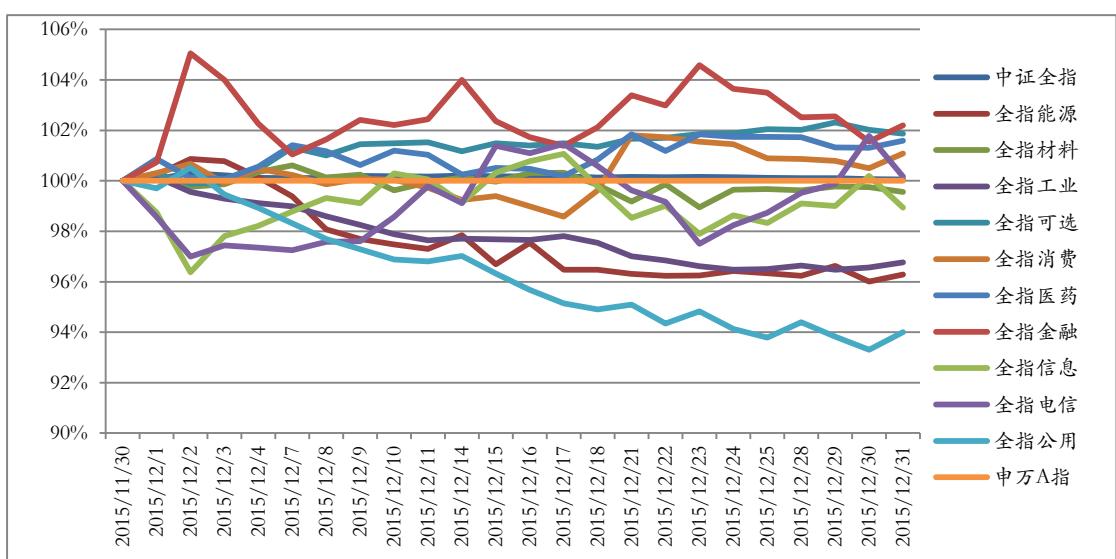


图 8 行业指数本月超额收益对比



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 12 月份核心指数的估值水平持续回升，市场平均动态（2016 年）市盈率为 18.07 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 9.96 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	16.96	10.20	9.96	1.19
上证 180	19.07	11.39	10.96	1.34
深证成指	62.84	34.22	30.50	3.81
深证 100	42.38	23.49	22.02	3.06
中小板指	72.16	39.91	35.94	5.51
中小 300	89.71	48.19	41.79	5.48
创业板指	160.83	72.01	59.31	9.87
沪深 300	21.98	13.03	12.47	1.53
中证 500	84.52	44.69	37.63	3.47
申万 A 指	34.54	20.18	18.07	2.24

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	39.51	29.38	24.55	1.02
全指材料	92.44	49.62	41.63	2.54
全指工业	65.32	33.63	28.62	2.84
全指可选	57.21	31.21	26.89	3.59
全指消费	54.92	32.78	28.53	3.97
全指医药	89.66	51.03	47.44	5.67
全指金融	14.85	9.01	8.70	1.31
全指信息	159.85	77.65	62.82	7.00
全指电信	116.55	55.16	42.06	2.37
全指公用	32.46	18.92	15.96	1.91
中证全指	<b>34.31</b>	<b>20.13</b>	<b>17.96</b>	<b>2.22</b>

## 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	36.00	6.51	18.01	9.50
600016	民生银行	9.64	11.70	18.39	6.94
601166	兴业银行	17.07	9.07	32.37	5.54
600036	招商银行	17.99	4.59	17.33	4.52
600000	浦发银行	18.27	-2.04	25.32	4.15
贡献前 5 名样本股					
代码	简称	收盘	涨跌幅%	换手率%	贡献点数
600016	民生银行	9.64	11.70	18.39	17.60
601318	中国平安	36.00	6.51	18.01	14.08
601166	兴业银行	17.07	9.07	32.37	10.84
600030	中信证券	19.35	9.76	70.47	7.99
601169	北京银行	10.53	13.59	34.37	7.56
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
601169	北京银行	10.53	13.59	34.37	7.56
600016	民生银行	9.64	11.70	18.39	17.60
600887	伊利股份	16.43	11.39	43.61	6.02
600104	上汽集团	21.22	10.93	23.56	4.09
600048	保利地产	10.64	10.83	81.46	3.95
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
600518	康美药业	16.95	-8.92	29.21	-3.02
601989	中国重工	9.40	-6.56	44.20	-3.60
600010	包钢股份	3.61	-3.73	22.85	-0.80
600018	上港集团	6.48	-3.57	26.61	-0.44
600150	中国船舶	34.83	-2.49	59.15	-0.37

## 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	36.00	6.51	18.01	5.76
600016	民生银行	9.64	11.70	18.39	4.21
601166	兴业银行	17.07	9.07	32.37	3.36
600036	招商银行	17.99	4.59	17.33	2.74
600000	浦发银行	18.27	-2.04	25.32	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
600016	民生银行	9.64	11.70	18.39	35.29
601318	中国平安	36.00	6.51	18.01	28.29
601166	兴业银行	17.07	9.07	32.37	21.82
600030	中信证券	19.35	9.76	70.47	16.06
601169	北京银行	10.53	13.59	34.37	15.32
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
600085	同仁堂	44.61	67.77	114.84	14.65
600739	辽宁成大	22.60	42.77	76.50	9.81
600649	城投控股	23.16	42.17	95.68	12.14
600718	东软集团	31.05	31.74	65.94	7.64
600645	中源协和	65.01	30.28	119.47	4.81
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
601618	中国中冶	6.02	-22.72	67.74	-10.25
601919	中国远洋	9.02	-22.44	49.87	-9.43
600352	浙江龙盛	11.64	-13.20	67.41	-4.81
600516	方大炭素	12.51	-13.19	263.20	-2.33
600643	爱建集团	14.65	-12.43	128.31	-2.56

### 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	24.43	62.11	65.23	3.44
000651	格力电器	22.35	21.93	65.61	1.69
000001	平安银行	11.99	2.13	27.13	1.25
000725	京东方 A	2.97	1.37	44.88	1.15
000333	美的集团	32.82	22.33	31.22	1.11
贡献前 5 名样本股					
代码	简称	收盘	涨跌幅%	换手率%	贡献点数
000002	万科 A	24.43	62.11	65.23	167.13
000651	格力电器	22.35	21.93	65.61	38.56
000333	美的集团	32.82	22.33	31.22	25.60
002202	金风科技	22.79	39.56	189.56	21.22
300104	乐视网	58.80	21.24	28.24	20.71
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
300020	银江股份	24.52	74.89	102.30	9.20
000002	万科 A	24.43	62.11	65.23	167.13
002292	奥飞动漫	51.71	49.88	122.81	14.32
300288	朗玛信息	61.72	48.44	150.80	5.02
002019	亿帆鑫富	40.00	46.04	216.26	5.40
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
002310	东方园林	26.46	-30.91	115.78	-10.93
002092	中泰化学	8.80	-24.91	97.25	-6.13
002191	劲嘉股份	15.36	-20.08	113.66	-6.83
002063	远光软件	21.14	-20.02	138.43	-4.85
000021	深科技	12.06	-18.24	117.22	-4.22

#### 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	24.43	62.11	65.23	7.65
000651	格力电器	22.35	21.93	65.61	3.76
000001	平安银行	11.99	2.13	27.13	2.77
000725	京东方 A	2.97	1.37	44.88	2.56
000333	美的集团	32.82	22.33	31.22	2.46
贡献前 5 名样本股					
代码	简称	收盘	涨跌幅%	换手率%	贡献点数
000002	万科 A	24.43	62.11	65.23	127.91
000651	格力电器	22.35	21.93	65.61	29.52
000333	美的集团	32.82	22.33	31.22	19.60
002202	金风科技	22.79	39.56	189.56	16.24
300104	乐视网	58.80	21.24	28.24	15.85
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
000002	万科 A	24.43	62.11	65.23	127.91
002292	奥飞动漫	51.71	49.88	122.81	10.96
002202	金风科技	22.79	39.56	189.56	16.24
000012	南玻 A	13.35	34.17	123.31	6.23
000878	云南铜业	13.85	24.77	251.78	3.59
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
000839	中信国安	20.35	-12.92	40.00	-5.10
000413	东旭光电	9.08	-12.02	74.43	-3.54
000009	中国宝安	17.96	-10.20	151.39	-4.20
300059	东方财富	52.03	-8.25	129.09	-8.31
002673	西部证券	32.91	-8.18	228.09	-4.62

## 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	13.45	-2.04	65.48	3.87
002450	康得新	38.10	7.78	57.98	3.37
002415	海康威视	34.39	2.38	28.10	3.20
002202	金风科技	22.79	39.56	189.56	2.54
002594	比亚迪	64.40	2.74	62.28	2.37
贡献前 5 名样本股					
代码	简称	收盘	涨跌幅%	换手率%	贡献点数
002202	金风科技	22.79	39.56	189.56	60.32
002292	奥飞动漫	51.71	49.88	122.81	40.70
002450	康得新	38.10	7.78	57.98	20.40
002456	欧菲光	31.02	20.65	143.94	19.66
002153	石基信息	151.00	21.87	47.05	17.31
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
002292	奥飞动漫	51.71	49.88	122.81	40.70
002202	金风科技	22.79	39.56	189.56	60.32
002153	石基信息	151.00	21.87	47.05	17.31
002456	欧菲光	31.02	20.65	143.94	19.66
002428	云南锗业	20.28	20.28	167.72	8.99
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
002310	东方园林	26.46	-30.91	115.78	-31.05
002092	中泰化学	8.80	-24.91	97.25	-17.41
002191	劲嘉股份	15.36	-20.08	113.66	-19.42
002063	远光软件	21.14	-20.02	138.43	-13.80
002095	生意宝	73.59	-15.20	296.65	-8.14

## 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	13.45	-2.04	65.48	2.05
002450	康得新	38.10	7.78	57.98	1.78
002415	海康威视	34.39	2.38	28.10	1.70
002202	金风科技	22.79	39.56	189.56	1.34
002594	比亚迪	64.40	2.74	62.28	1.26
贡献前 5 名样本股					
代码	简称	收盘	涨跌幅%	换手率%	贡献点数
002202	金风科技	22.79	39.56	189.56	6.85
002292	奥飞动漫	51.71	49.88	122.81	4.62
002094	青岛金王	31.15	137.06	172.21	2.48
002407	多氟多	76.26	34.71	334.62	2.48
002460	赣锋锂业	62.93	32.74	405.05	2.42
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
002094	青岛金王	31.15	137.06	172.21	2.48
002604	龙力生物	14.80	79.61	185.06	1.50
002292	奥飞动漫	51.71	49.88	122.81	4.62
002019	亿帆鑫富	40.00	46.04	216.26	1.74
002202	金风科技	22.79	39.56	189.56	6.85
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
002310	东方园林	26.46	-30.91	115.78	-3.53
002092	中泰化学	8.80	-24.91	97.25	-1.98
002191	劲嘉股份	15.36	-20.08	113.66	-2.21
002063	远光软件	21.14	-20.02	138.43	-1.57
002297	博云新材	14.51	-17.18	145.33	-0.60

## 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	52.03	-8.25	129.09	5.22
300104	乐视网	58.80	21.24	28.24	5.11
300027	华谊兄弟	41.48	8.99	131.64	3.10
300024	机器人	68.50	-7.28	74.83	2.98
300070	碧水源	51.77	3.50	33.53	2.62
贡献前 5 名样本股					
代码	简称	收盘	涨跌幅%	换手率%	贡献点数
300104	乐视网	58.80	21.24	28.24	24.28
300020	银江股份	24.52	74.89	102.30	10.78
300027	华谊兄弟	41.48	8.99	131.64	6.94
300178	腾邦国际	29.10	42.93	218.67	6.06
300288	朗玛信息	61.72	48.44	150.80	5.89
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
300020	银江股份	24.52	74.89	102.30	10.78
300288	朗玛信息	61.72	48.44	150.80	5.89
300178	腾邦国际	29.10	42.93	218.67	6.06
300134	大富科技	30.10	31.15	115.91	4.06
300352	北信源	62.40	29.81	165.85	4.68
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
300152	科融环境	11.21	-19.00	167.54	-3.29
300033	同花顺	71.05	-12.27	199.64	-4.55
300053	欧比特	40.75	-11.99	151.69	-2.22
300202	聚龙股份	32.19	-11.03	104.97	-2.31
300295	三六五网	49.60	-10.23	155.29	-1.73

## 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	36.00	6.51	18.01	3.97
600016	民生银行	9.64	11.70	18.39	2.90
601166	兴业银行	17.07	9.07	32.37	2.32
000002	万科 A	24.43	62.11	65.23	1.93
600036	招商银行	17.99	4.59	17.33	1.89
贡献前 5 名样本股					
代码	简称	收盘	涨跌幅%	换手率%	贡献点数
000002	万科 A	24.43	62.11	65.23	31.38
600016	民生银行	9.64	11.70	18.39	11.35
601318	中国平安	36.00	6.51	18.01	9.09
000651	格力电器	22.35	21.93	65.61	7.45
601166	兴业银行	17.07	9.07	32.37	6.99
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
600085	同仁堂	44.61	67.77	114.84	4.70
000002	万科 A	24.43	62.11	65.23	31.38
002292	奥飞动漫	51.71	49.88	122.81	3.38
600739	辽宁成大	22.60	42.77	76.50	3.17
600649	城投控股	23.16	42.17	95.68	3.92
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
601618	中国中冶	6.02	-22.72	67.74	-3.29
601919	中国远洋	9.02	-22.44	49.87	-3.02
601866	中海集运	7.04	-19.36	49.34	-2.02
600373	中文传媒	23.49	-13.23	46.70	-0.78
600352	浙江龙盛	11.64	-13.20	67.41	-1.54

## 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%
600978	宜华木业	22.33	0.00	0.00	0.61
000748	长城信息	34.88	0.00	0.00	0.52
002466	天齐锂业	140.75	-9.60	184.84	0.51
002405	四维图新	38.80	-4.90	126.32	0.51
600654	中安消	28.84	-10.21	22.09	0.51
贡献前 5 名样本股					
代码	简称	收盘	涨跌幅%	换手率%	贡献点数
600160	巨化股份	23.47	29.96	79.93	8.68
600816	安信信托	22.77	28.86	81.24	7.88
600645	中源协和	65.01	30.28	119.47	7.19
000012	南玻 A	13.35	34.17	123.31	6.82
000078	海王生物	23.96	34.76	177.55	6.59
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
000563	陕国投 A	15.12	35.73	138.75	4.13
600736	苏州高新	11.00	34.97	60.00	3.64
000078	海王生物	23.96	34.76	177.55	6.59
600618	氯碱化工	16.14	34.39	124.90	1.65
000012	南玻 A	13.35	34.17	123.31	6.82
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
600058	五矿发展	22.70	-32.40	165.61	-8.39
600428	中远航运	10.26	-28.00	119.70	-5.94
002092	中泰化学	8.80	-24.91	97.25	-5.17
600112	天成控股	16.76	-23.33	182.62	-3.78
002191	劲嘉股份	15.36	-20.08	113.66	-6.36

## 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	36.00	6.51	18.01	1.71
600016	民生银行	9.64	11.70	18.39	1.14
600036	招商银行	17.99	4.59	17.33	0.82
601166	兴业银行	17.07	9.07	32.37	0.77
600030	中信证券	19.35	9.76	70.47	0.75
贡献前 5 名样本股					
代码	简称	收盘	涨跌幅%	换手率%	贡献点数
000002	万科 A	24.43	62.11	65.23	11.30
600016	民生银行	9.64	11.70	18.39	5.00
601318	中国平安	36.00	6.51	18.01	4.38
000651	格力电器	22.35	21.93	65.61	3.62
600030	中信证券	19.35	9.76	70.47	2.79
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
002468	艾迪西	39.13	185.41	1.03	0.66
002602	世纪华通	34.05	157.17	70.78	0.74
300466	赛摩电气	65.53	140.21	314.58	0.16
600306	商业城	29.66	139.19	203.94	0.39
002094	青岛金王	31.15	137.06	172.21	0.69
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
000688	建新矿业	10.29	-39.72	152.35	-0.40
300189	神农基因	7.41	-34.71	205.55	-0.65
600058	五矿发展	22.70	-32.40	165.61	-0.90
300418	昆仑万维	40.90	-31.72	259.61	-1.08
002310	东方园林	26.46	-30.91	115.78	-1.03

## 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。