

广发基金指数月报

(2016年1月4日—2016年1月29日)

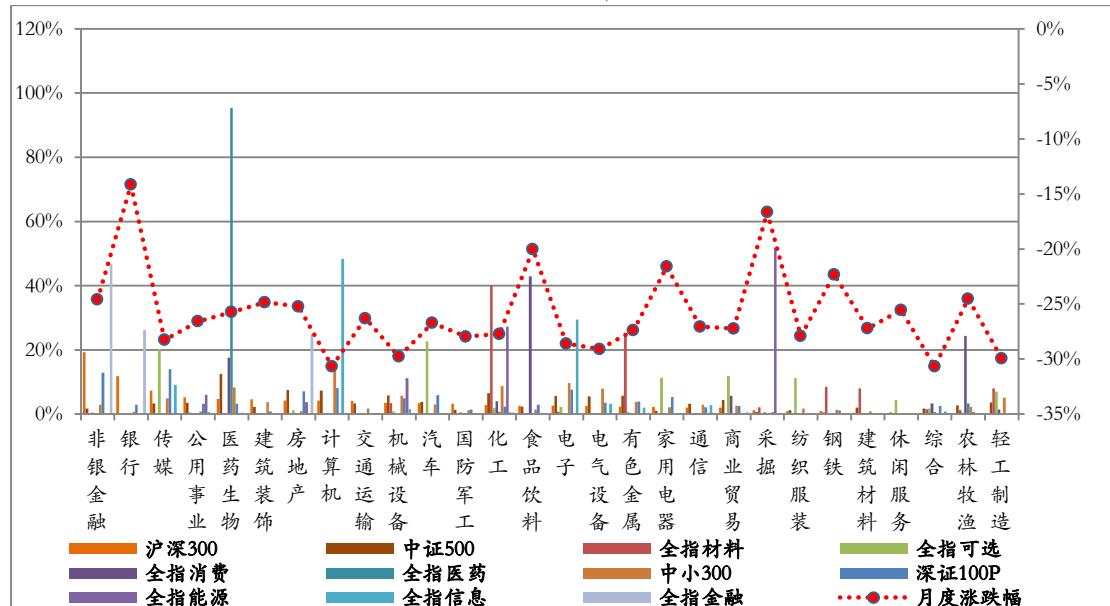
广发基金数量投资部

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

本月市场大幅下跌，申万28个一级行业全部下跌，银行和采掘行业表现相对较好，下跌不到17%，而综合和计算机行业跌幅均在30%以上。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19.32%；医药生物行业对中证500指数贡献最大，贡献率为12.54%；计算机行业对中小300指数贡献居首，贡献率为15.17%；传媒行业对深证100指数贡献最大，贡献率为13.98%。

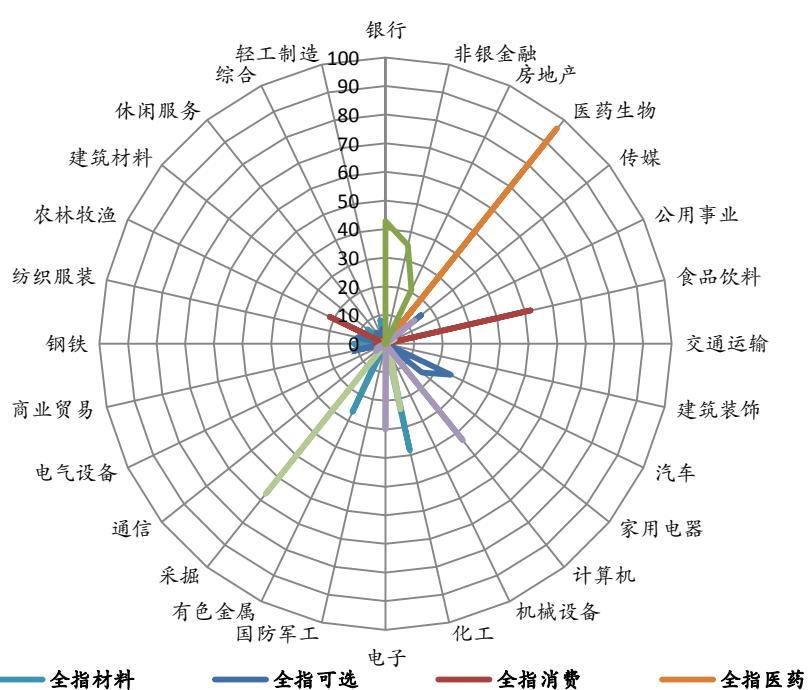
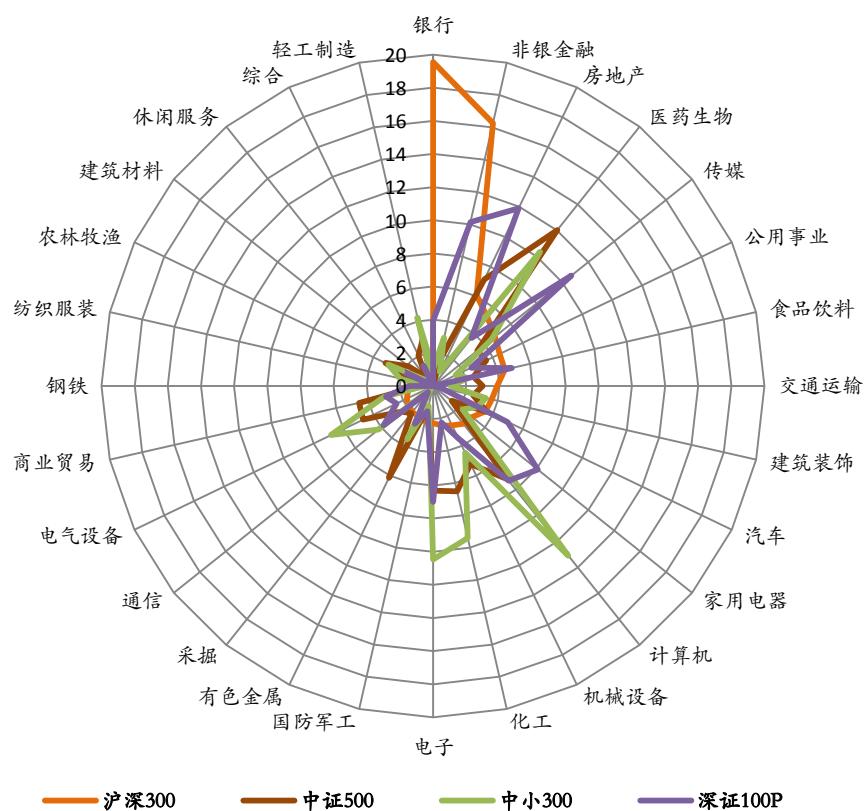
图1 成份行业贡献率与月度涨跌幅

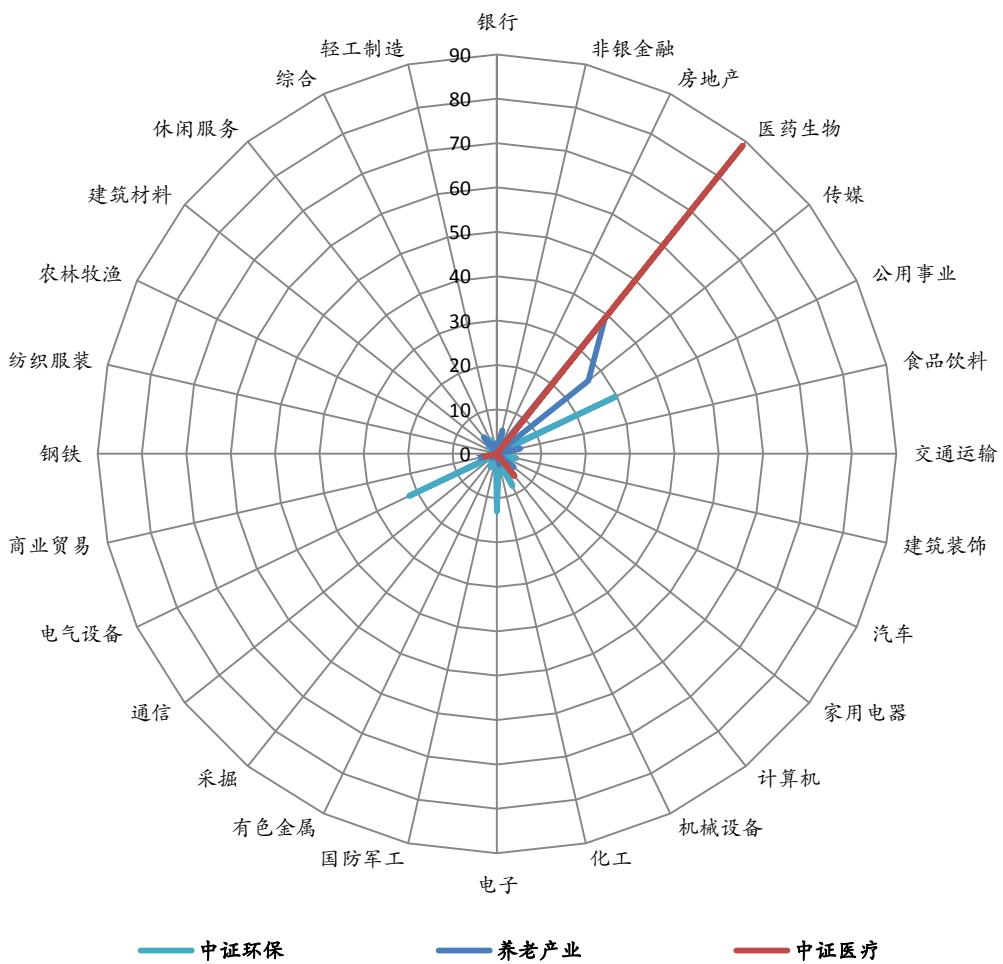


以巨潮数据库提供的权重数据计算，本月末银行业在沪深300指数中所占比重居首，为19.54%。医药生物、计算机和房地产行业在中证500指数中权重居前，依次为12.02%、7.20%和7.13%。计算机、电子和医药生物行业在中小300指数中权重居前，分别为13.09%、10.47%和10.34%。房地产、传媒和非银金融

行业在深证 100 指数中权重位列前三，依次为 11.89%、10.69% 和 10.15%。

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 0.823%。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 2.64%。

表 1 基金净值与跟踪误差

基金简称	2016 年 1 月		2015 年 12 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	1.2967	1.5867	1.6440	1.9340	1.4558	2008/12/30
广发中证 500ETF 联接	1.1527	1.1527	1.5691	1.5691	2.6404	2009/11/26
广发中小板 300ETF	1.2585	1.1434	1.7397	1.5806	0.8234	2011/6/3

广发中小板 300 联接	1.0512	1.0512	1.4370	1.4370	1.8101	2011/6/9
广发深证 100 分级	0.8777	0.9969	1.1871	1.2750	5.4323	2012/5/7
广发中证 500ETF	1.5002	1.5002	2.0728	2.0728	1.4557	2013/4/11
广发全指可选消费 ETF	1.3260	1.3260	1.8387	1.8387	1.0489	2014/6/3
广发全指医药卫生 ETF	1.1026	1.1026	1.4724	1.4724	0.5641	2014/12/1
广发全指信息技术 ETF	1.0298	1.0298	1.4410	1.4410	1.2618	2015/1/8
广发中证养老产业	0.8524	0.8524	1.1334	1.1334	1.5417	2015/2/13
广发全指金融地产 ETF	0.6863	0.6863	0.8548	0.8548	0.3869	2015/3/23
广发中证环保产业	0.6403	0.6403	0.8926	0.8926	2.4839	2015/3/25
广发全指原材料 ETF	0.6672	0.6672	0.9160	0.9160	1.1645	2015/6/25
广发全指能源 ETF	0.5759	0.5759	0.7029	0.7029	0.4975	2015/6/25
广发全指主要消费 ETF	0.7708	0.7708	0.9892	0.9892	1.0493	2015/7/1
广发中证医疗分级	1.0000	0.6584	0.9129	0.9249	5.9470	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

1月沪深两市大幅下挫，覆盖两市的申万 A 指下跌 25.81%。指数方面，本期核心市场指数中，上证 50 跌幅最小，下跌 18.5%；中证 500 表现最差，下跌 28.2%。

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	2420.80	2417.02	2417.02	1900.35	1973.01	-18.50%	6909.76
上证 180	7995.77	7986.39	7986.39	6077.51	6308.48	-21.10%	16133.91
深证成指	12664.89	12650.72	12659.41	8986.52	9418.20	-25.64%	30880.28
深证 100P	4354.86	4348.53	4353.09	3221.55	3374.35	-22.52%	11324.06
中小板指	8393.83	8385.00	8385.00	5973.12	6272.91	-25.27%	7074.91
中小板 300	1797.90	1795.16	1795.16	1238.00	1295.64	-27.94%	15516.20
创业板指	2714.05	2706.28	2710.30	1888.25	1994.07	-26.53%	6723.92
沪深 300	3731.00	3725.86	3726.24	2839.29	2946.09	-21.04%	26471.89

中证 500	7617.69	7615.51	7624.10	5240.65	5469.13	-28.20%	20408.47
申万 A 指	4186.66	4181.64	4183.56	2985.71	3106.15	-25.81%	107458.90

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	2106.32	2104.51	2112.00	1658.18	1724.47	-18.13%	2221.08
全指材料	3629.44	3625.31	3628.63	2529.19	2641.47	-27.22%	13544.86
全指工业	4876.94	4885.08	4890.90	3361.51	3508.36	-28.06%	20417.46
全指可选	6924.08	6912.06	6913.42	4798.80	5005.81	-27.70%	13662.74
全指消费	8937.25	8911.20	8911.20	6613.91	6925.55	-22.51%	4514.79
全指医药	11200.78	11174.84	11174.84	7998.03	8371.13	-25.26%	5156.40
全指金融	6008.03	5987.11	5987.11	4634.80	4817.57	-19.81%	11238.23
全指信息	7944.96	7926.83	7927.93	5381.86	5649.64	-28.89%	15857.97
全指电信	7334.62	7362.54	7395.15	4994.77	5220.86	-28.82%	2463.46
全指公用	3123.44	3122.89	3127.52	2244.60	2314.32	-25.90%	1862.97
中证全指	5592.64	5585.08	5586.90	3993.11	4154.91	-25.71%	104202.90

图3 核心指数月度表现

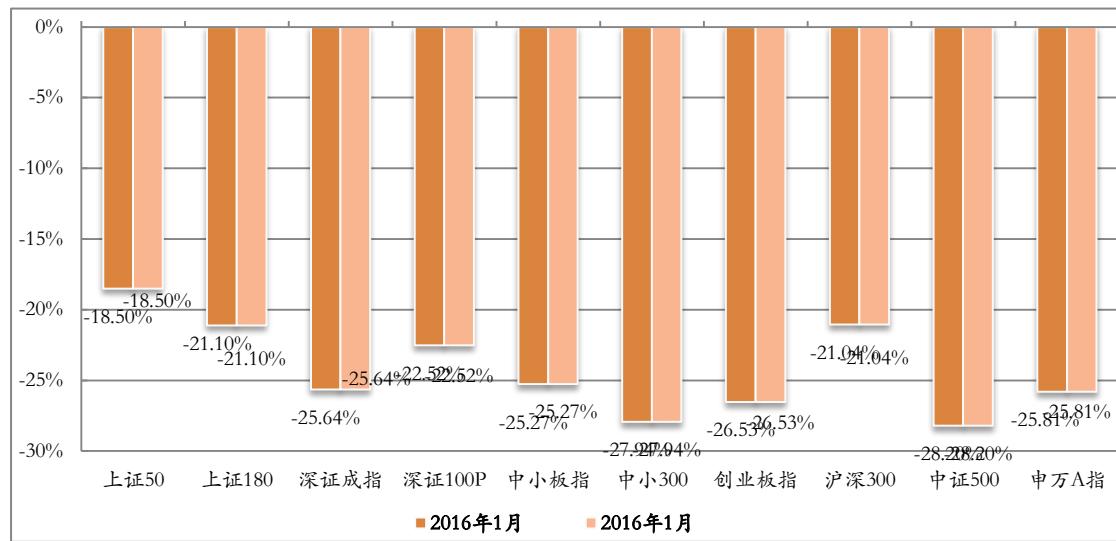


图4 核心指数本月绝对收益

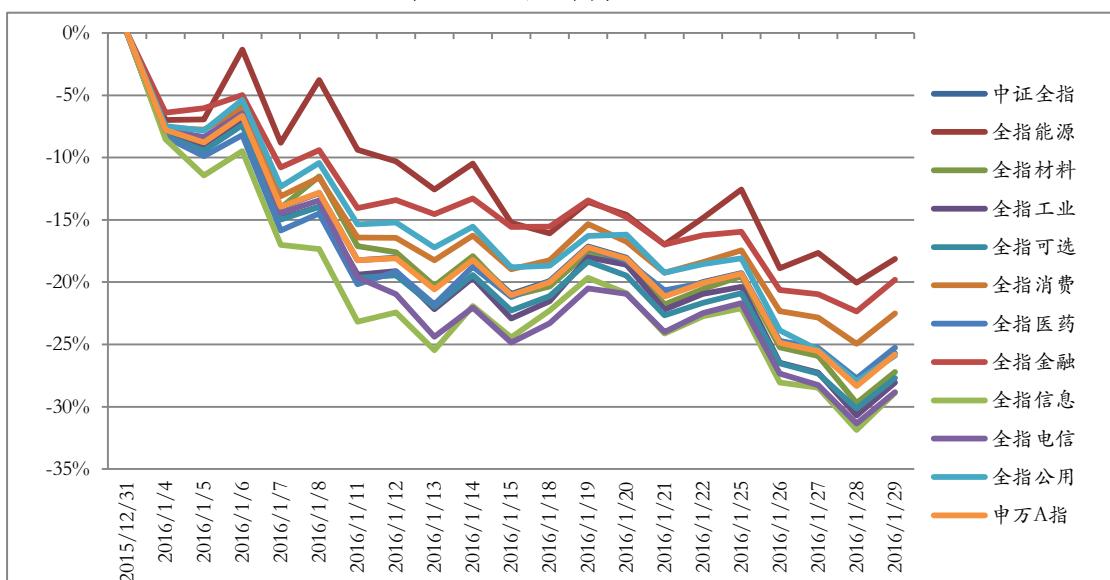
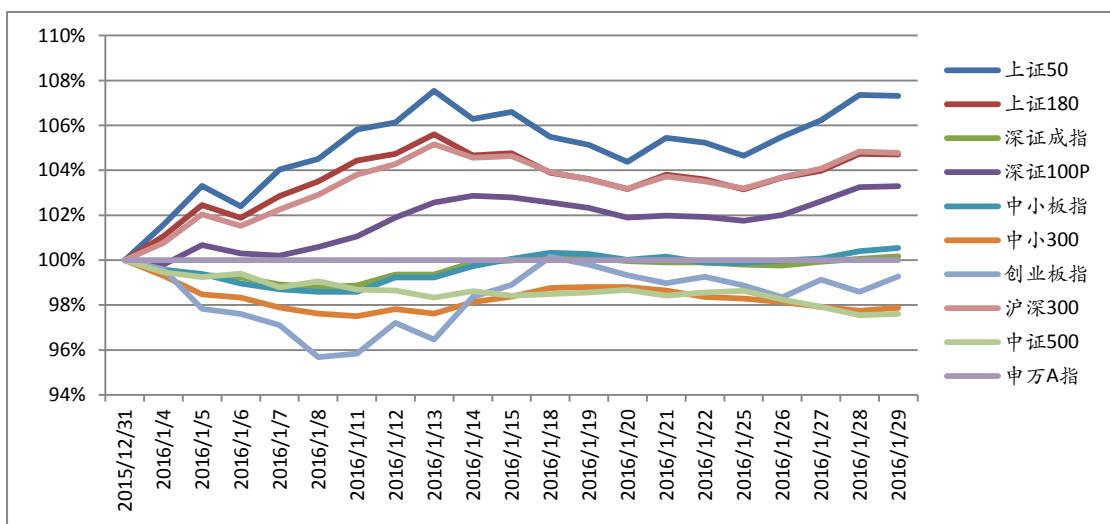


图5 核心指数本月超额收益对比



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

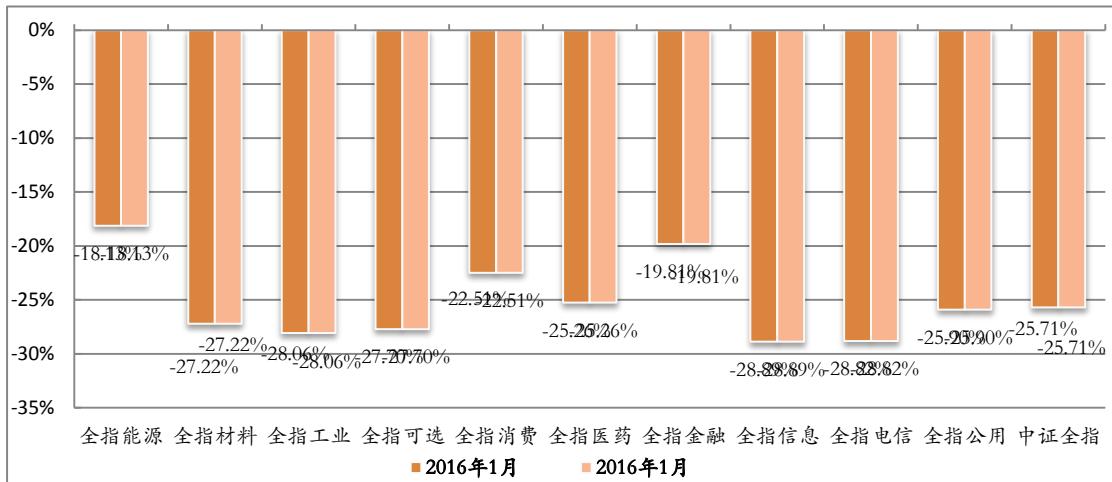


图 7 行业指数本月绝对收益

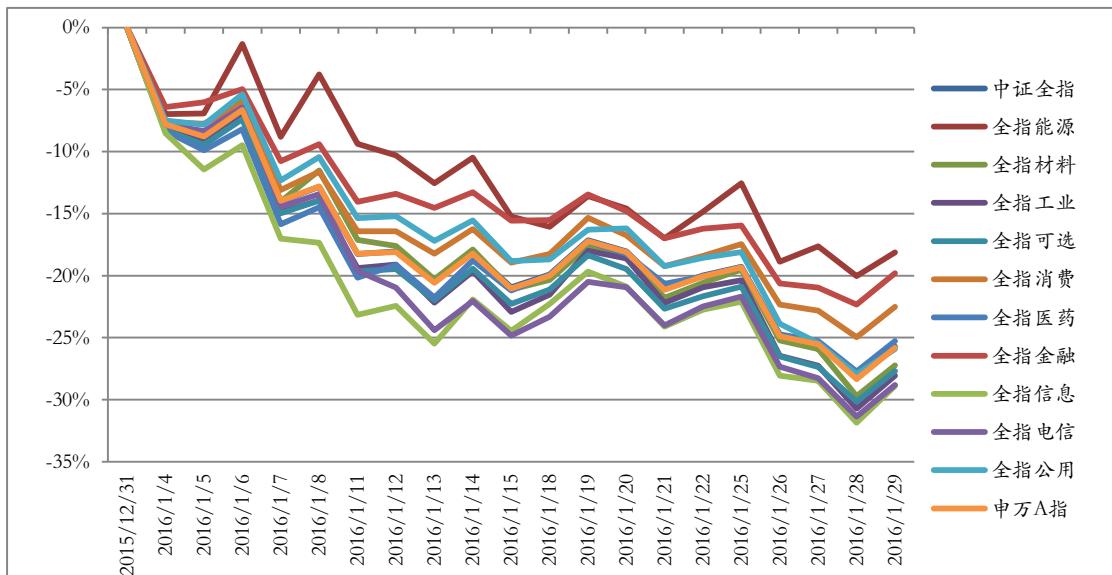
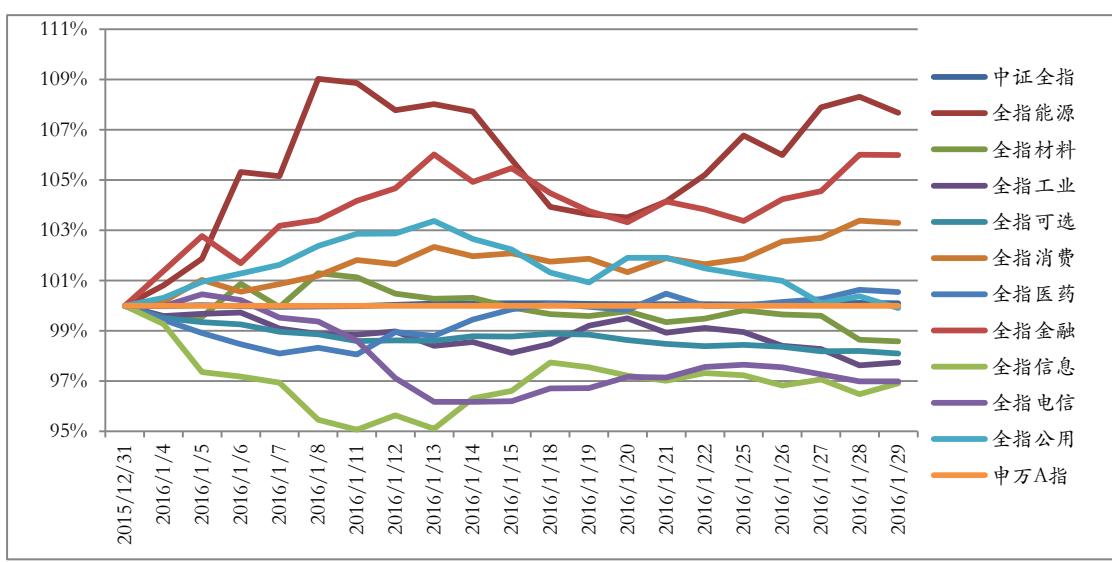


图 8 行业指数本月超额收益对比



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

2016年1月份核心指数的估值水平明显回落，市场平均动态（2016年）市盈率为12.77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8.03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	13.94	8.46	8.03	0.98
上证180	15.34	9.25	8.57	1.08
深证成指	47.02	25.38	18.80	2.84
深证100	32.92	18.00	14.97	2.37
中小板指	53.55	29.35	22.39	4.10
中小300	64.69	34.61	23.80	3.94
创业板指	123.35	54.14	30.67	7.36
沪深300	17.55	10.49	9.59	1.22
中证500	60.50	32.06	21.34	2.49
申万A指	26.30	15.46	12.77	1.70

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	34.13	25.62	22.55	0.88
全指材料	67.18	37.47	24.39	1.85
全指工业	47.65	24.59	17.81	2.04
全指可选	41.75	23.02	16.48	2.61
全指消费	42.93	25.89	18.80	3.08
全指医药	68.32	39.24	28.80	4.30
全指金融	12.03	7.33	6.84	1.06
全指信息	113.34	55.28	31.64	4.95
全指电信	81.40	38.12	23.42	1.65
全指公用	24.25	14.37	10.76	1.43
中证全指	26.07	15.39	12.69	1.68

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	30.18	-16.17	13.90	9.77
600016	民生银行	8.59	-10.89	6.87	7.59
601166	兴业银行	14.46	-15.29	15.26	5.76
600000	浦发银行	16.90	-7.50	14.13	4.71
600036	招商银行	14.99	-16.68	8.53	4.62
贡献前 5 名样本股					
代码	简称	收盘	涨跌幅%	换手率%	贡献点数
601088	中国神华	13.40	-10.49	36.36	-1.84
601800	中国交建	10.80	-19.46	44.89	-2.39
601857	中国石油	7.46	-10.66	30.79	-2.55
601998	中信银行	5.55	-23.13	54.03	-3.10
600958	东方证券	18.18	-21.94	49.99	-3.20
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
601288	农业银行	2.99	-7.43	16.89	-5.41
600000	浦发银行	16.90	-7.50	14.13	-7.53
600519	贵州茅台	200.65	-8.04	12.70	-5.20
601398	工商银行	4.10	-10.48	10.71	-6.10
601088	中国神华	13.40	-10.49	36.36	-1.84
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
600150	中国船舶	22.45	-35.54	64.16	-5.03
600050	中国联通	4.05	-34.46	29.95	-10.66
601989	中国重工	6.19	-34.15	52.64	-17.36
600637	东方明珠	25.69	-32.20	28.88	-13.22
600999	招商证券	14.98	-30.97	36.36	-11.50

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	30.18	-16.17	13.90	6.11
600016	民生银行	8.59	-10.89	6.87	4.74
601166	兴业银行	14.46	-15.29	15.26	3.60
600000	浦发银行	16.90	-7.50	14.13	2.95
600036	招商银行	14.99	-16.68	8.53	2.89
贡献前 5 名样本股					
代码	简称	收盘	涨跌幅%	换手率%	贡献点数
600383	金地集团	16.19	17.32	64.07	6.36
601018	宁波港	8.16	0.00	0.00	0.00
600271	航天信息	55.91	0.00	0.00	0.00
600690	青岛海尔	9.92	0.00	0.00	0.00
600153	建发股份	17.31	0.00	0.00	0.00
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
600383	金地集团	16.19	17.32	64.07	6.36
600019	宝钢股份	5.21	-6.63	75.78	-2.02
601288	农业银行	2.99	-7.43	16.89	-10.80
600000	浦发银行	16.90	-7.50	14.13	-15.08
600519	贵州茅台	200.65	-8.04	12.70	-10.40
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
600645	中源协和	35.39	-45.56	160.77	-9.55
600649	城投控股	13.30	-42.57	80.97	-17.47
600158	中体产业	15.15	-41.91	114.21	-8.73
600588	用友网络	18.63	-41.43	68.24	-9.14
600325	华发股份	9.68	-40.61	51.80	-5.40

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	24.43	0.00	0.00	2.94
000651	格力电器	18.73	-16.20	24.88	1.81
000001	平安银行	10.00	-16.60	17.73	1.34
300104	乐视网	58.80	0.00	0.00	1.21
000333	美的集团	27.31	-16.79	21.42	1.19
贡献前 5 名样本股					
代码	简称	收盘	涨跌幅%	换手率%	贡献点数
000983	西山煤电	7.14	17.43	160.83	3.23
000933	神火股份	5.63	13.05	240.94	1.50
000002	万科 A	24.43	0.00	0.00	0.00
300104	乐视网	58.80	0.00	0.00	0.00
002465	海格通信	16.69	0.00	0.00	0.00
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
000983	西山煤电	7.14	17.43	160.83	3.23
000933	神火股份	5.63	13.05	240.94	1.50
002007	华兰生物	43.73	-0.61	58.33	-0.18
002638	勤上光电	14.89	-2.81	64.32	-0.24
000738	中航动控	30.65	-3.07	148.25	-0.84
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
002075	沙钢股份	11.27	-52.19	2.28	-14.39
300257	开山股份	15.70	-49.11	66.83	-10.49
300352	北信源	31.80	-49.04	144.66	-8.46
000958	东方能源	13.30	-48.29	68.83	-6.60
000558	莱茵体育	14.39	-48.05	187.15	-9.85

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	0.00	0.00	6.50
000651	格力电器	18.73	-16.20	24.88	4.01
000001	平安银行	10.00	-16.60	17.73	2.96
300104	乐视网	58.80	0.00	0.00	2.67
000333	美的集团	27.31	-16.79	21.42	2.63
贡献前 5 名样本股					
代码	简称	收盘	涨跌幅%	换手率%	贡献点数
002065	东华软件	25.10	0.00	0.00	0.00
300104	乐视网	58.80	0.00	0.00	0.00
000002	万科 A	24.43	0.00	0.00	0.00
000876	新希望	18.99	0.00	0.00	0.00
002465	海格通信	16.69	0.00	0.00	0.00
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
000738	中航动控	30.65	-3.07	148.25	-0.67
300498	温氏股份	43.32	-5.29	33.52	-1.04
000709	河钢股份	2.96	-11.11	162.24	-2.62
300017	网宿科技	52.20	-12.99	71.78	-5.67
000625	长安汽车	14.76	-13.02	31.34	-7.19
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
000793	华闻传媒	8.60	-42.78	76.16	-16.74
002292	奥飞动漫	30.80	-40.44	162.00	-14.13
000559	万向钱潮	13.69	-39.51	71.58	-16.63
000917	电广传媒	16.08	-39.46	109.75	-18.64
300058	蓝色光标	9.02	-38.76	40.35	-11.90

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	10.64	-20.89	48.45	3.92
002450	康得新	29.90	-21.52	16.58	3.25
002415	海康威视	26.55	-22.80	31.80	2.95
002304	洋河股份	58.81	-14.20	15.05	2.75
002736	国信证券	14.59	-26.13	33.15	2.25
贡献前 5 名样本股					
代码	简称	收盘	涨跌幅%	换手率%	贡献点数
002465	海格通信	16.69	0.00	0.00	0.00
002018	华信国际	44.08	0.00	0.00	0.00
002065	东华软件	25.10	0.00	0.00	0.00
002049	同方国芯	60.15	0.00	0.00	0.00
002573	清新环境	22.44	0.00	0.00	0.00
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
002007	华兰生物	43.73	-0.61	58.33	-0.49
002252	上海莱士	37.62	-5.41	22.02	-6.55
002051	中工国际	23.70	-6.44	144.47	-2.92
002269	美邦服饰	6.07	-9.54	8.14	-3.81
002311	海大集团	12.24	-12.38	31.14	-6.14
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
002153	石基信息	80.09	-46.96	58.05	-42.24
002005	德豪润达	5.55	-45.27	65.64	-24.68
002280	联络互动	34.74	-43.42	128.72	-32.85
002368	太极股份	39.00	-41.88	103.03	-33.91
002106	莱宝高科	7.88	-40.93	82.70	-15.56

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	10.64	-20.89	48.45	2.15
002450	康得新	29.90	-21.52	16.58	1.78
002415	海康威视	26.55	-22.80	31.80	1.62
002304	洋河股份	58.81	-14.20	15.05	1.51
002736	国信证券	14.59	-26.13	33.15	1.23
贡献前 5 名样本股					
代码	简称	收盘	涨跌幅%	换手率%	贡献点数
002371	七星电子	27.70	43.67	134.32	0.90
002465	海格通信	16.69	0.00	0.00	0.00
002018	华信国际	44.08	0.00	0.00	0.00
002065	东华软件	25.10	0.00	0.00	0.00
002049	同方国芯	60.15	0.00	0.00	0.00
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
002371	七星电子	27.70	43.67	134.32	0.90
002007	华兰生物	43.73	-0.61	58.33	-0.06
002638	勤上光电	14.89	-2.81	64.32	-0.08
002235	安妮股份	28.00	-3.78	151.84	-0.09
002503	搜于特	15.08	-4.80	39.68	-0.13
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
002075	沙钢股份	11.27	-52.19	2.28	-4.51
002153	石基信息	80.09	-46.96	58.05	-4.78
002308	威创股份	13.08	-46.94	59.57	-3.88
002002	鸿达兴业	13.85	-46.87	84.23	-2.80
002005	德豪润达	5.55	-45.27	65.64	-2.79

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%
300104	乐视网	58.80	0.00	0.00	6.67
300059	东方财富	38.55	-25.91	151.96	5.07
300017	网宿科技	52.20	-12.99	71.78	2.82
300024	机器人	49.42	-27.85	71.86	2.80
300070	碧水源	39.25	-24.18	30.63	2.70
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	0.00	0.00	0.00
300324	旋极信息	49.25	0.00	0.00	0.00
300088	长信科技	14.03	0.00	0.00	0.00
300238	冠昊生物	56.67	0.00	0.00	0.00
300043	互动娱乐	15.80	0.00	0.00	0.00
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
300498	温氏股份	43.32	-5.29	33.52	-1.54
300015	爱尔眼科	29.45	-6.74	32.96	-1.59
300017	网宿科技	52.20	-12.99	71.78	-8.38
300072	三聚环保	29.55	-13.01	57.53	-3.80
300012	华测检测	21.38	-13.05	52.80	-2.14
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
300257	开山股份	15.70	-49.11	66.83	-12.27
300352	北信源	31.80	-49.04	144.66	-9.90
300032	金龙机电	15.91	-47.66	109.22	-9.87
300096	易联众	14.36	-46.16	100.60	-9.69
300252	金信诺	22.75	-43.69	64.82	-7.67

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	30.18	-16.17	13.90	4.21
600016	民生银行	8.59	-10.89	6.87	3.27
601166	兴业银行	14.46	-15.29	15.26	2.48
000002	万科 A	24.43	0.00	0.00	2.44
600000	浦发银行	16.90	-7.50	14.13	2.03
贡献前 5 名样本股					
代码	简称	收盘	涨跌幅%	换手率%	贡献点数
600383	金地集团	16.19	17.32	64.07	2.04
000983	西山煤电	7.14	17.43	160.83	0.65
601699	潞安环能	7.07	10.13	133.66	0.28
000002	万科 A	24.43	0.00	0.00	0.00
300104	乐视网	58.80	0.00	0.00	0.00
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
000983	西山煤电	7.14	17.43	160.83	0.65
600383	金地集团	16.19	17.32	64.07	2.04
601699	潞安环能	7.07	10.13	133.66	0.28
002007	华兰生物	43.73	-0.61	58.33	-0.04
600188	兖州煤业	9.18	-2.86	71.62	-0.06
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
002153	石基信息	80.09	-46.96	58.05	-2.85
000793	华闻传媒	8.60	-42.78	76.16	-4.01
600649	城投控股	13.30	-42.57	80.97	-5.61
000156	华数传媒	19.20	-41.46	108.60	-0.67
600588	用友网络	18.63	-41.43	68.24	-2.89

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%
000748	长城信息	34.88	0.00	0.00	0.73
600654	中安消	28.84	0.00	0.00	0.71
002466	天齐锂业	117.00	-16.87	181.42	0.59
600122	宏图高科	19.42	0.00	0.00	0.57
000718	苏宁环球	13.19	0.00	0.00	0.52
贡献前 5 名样本股					
代码	简称	收盘	涨跌幅%	换手率%	贡献点数
002371	七星电子	27.70	43.67	134.32	2.61
000933	神火股份	5.63	13.05	240.94	1.31
600880	博瑞传播	7.94	5.87	70.92	0.67
600395	盘江股份	8.70	5.97	205.92	0.60
600864	哈投股份	11.11	2.11	86.43	0.09
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
002371	七星电子	27.70	43.67	134.32	2.61
000933	神火股份	5.63	13.05	240.94	1.31
600395	盘江股份	8.70	5.97	205.92	0.60
600880	博瑞传播	7.94	5.87	70.92	0.67
600864	哈投股份	11.11	2.11	86.43	0.09
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
300257	开山股份	15.70	-49.11	66.83	-11.44
600978	宜华木业	11.54	-48.32	16.92	-22.50
601777	力帆股份	9.07	-47.69	71.25	-5.48
600160	巨化股份	12.45	-46.95	73.65	-17.62
002308	威创股份	13.08	-46.94	59.57	-11.91

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	30.18	-16.17	13.90	1.91
600016	民生银行	8.59	-10.89	6.87	1.35
601166	兴业银行	14.46	-15.29	15.26	1.11
600036	招商银行	14.99	-16.68	8.53	0.91
000002	万科 A	24.43	0.00	0.00	0.85
贡献前 5 名样本股					
代码	简称	收盘	涨跌幅%	换手率%	贡献点数
600383	金地集团	16.19	17.32	64.07	0.93
002624	完美环球	36.00	71.18	97.02	0.33
000983	西山煤电	7.14	17.43	160.83	0.30
002371	七星电子	27.70	43.67	134.32	0.27
600610	中毅达	17.89	41.31	333.18	0.20
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
002785	万里石	19.35	231.34	220.00	0.14
300492	山鼎设计	36.40	106.94	380.85	0.08
002624	完美环球	36.00	71.18	97.02	0.33
300497	富祥股份	64.99	51.03	422.40	0.08
002782	可立克	30.66	44.15	524.74	0.08
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
600678	四川金顶	11.54	-58.32	253.24	-0.84
300275	梅安森	17.28	-52.53	108.43	-0.38
002075	沙钢股份	11.27	-52.19	2.28	-1.39
600139	西部资源	8.87	-51.50	90.97	-0.76
300109	新开源	50.73	-51.24	102.99	-0.76

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:

$$\text{动态PE} = \frac{\sum(\text{最新价格}_{\text{个股}} \times \text{最新总股本}_{\text{个股}})}{\sum(\text{最新滚动归属母公司利润}_{\text{个股}})}$$

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、申万宏源研究。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。