

广发基金指数月报

(2016年2月1日—2016年2月29日)

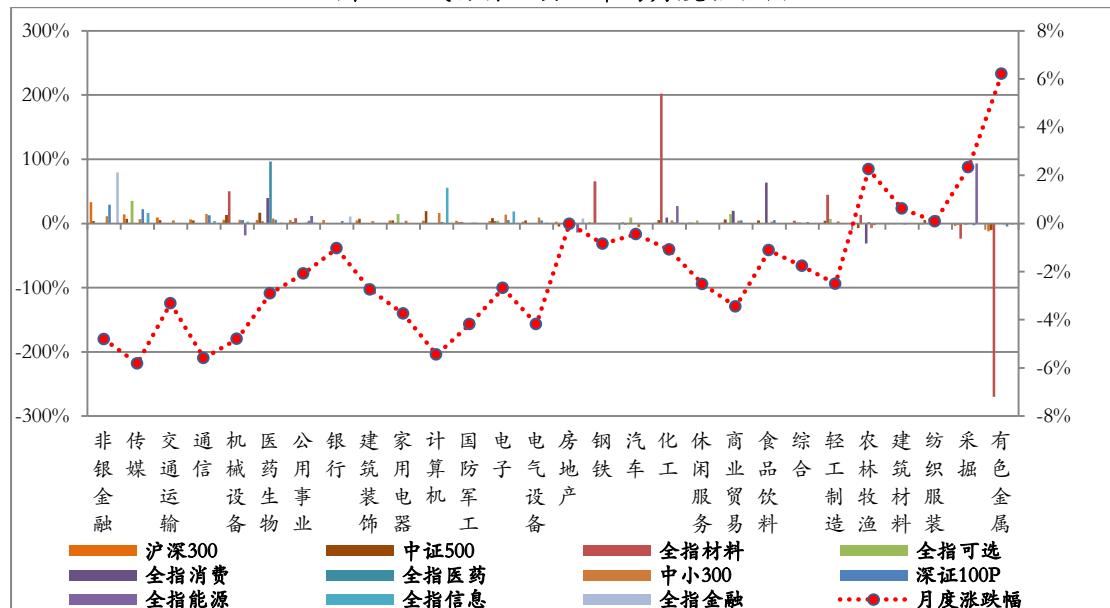
广发基金数量投资部

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

本月市场继续下跌，申万28个一级行业中5个行业上涨，有色金属涨幅为6.21%，表现最佳，而传媒和通信行业跌幅超过5%。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33.38%；计算机行业对中证500指数贡献最大，贡献率为19.21%；计算机行业对中小300指数贡献居首，贡献率为16.14%；非银金融行业对深证100指数贡献最大，贡献率为29.3%。

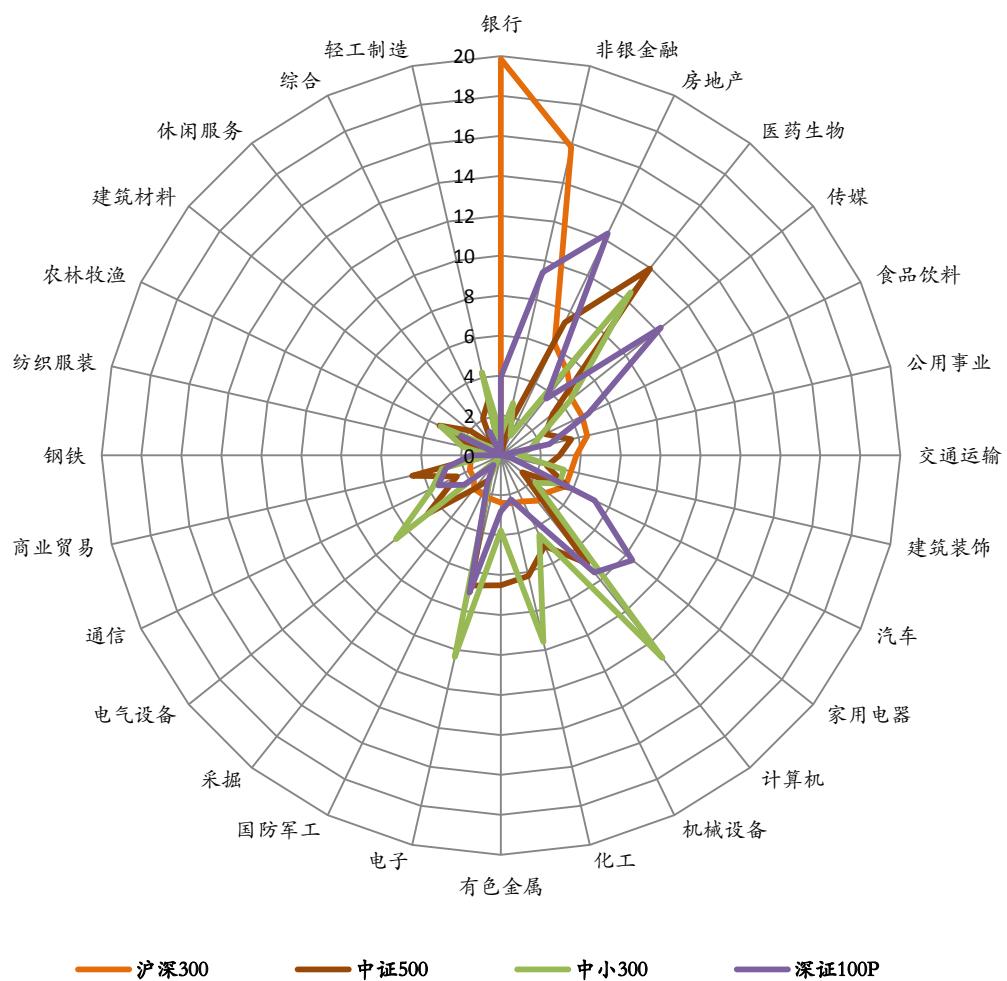
图1 成份行业贡献率与月度涨跌幅

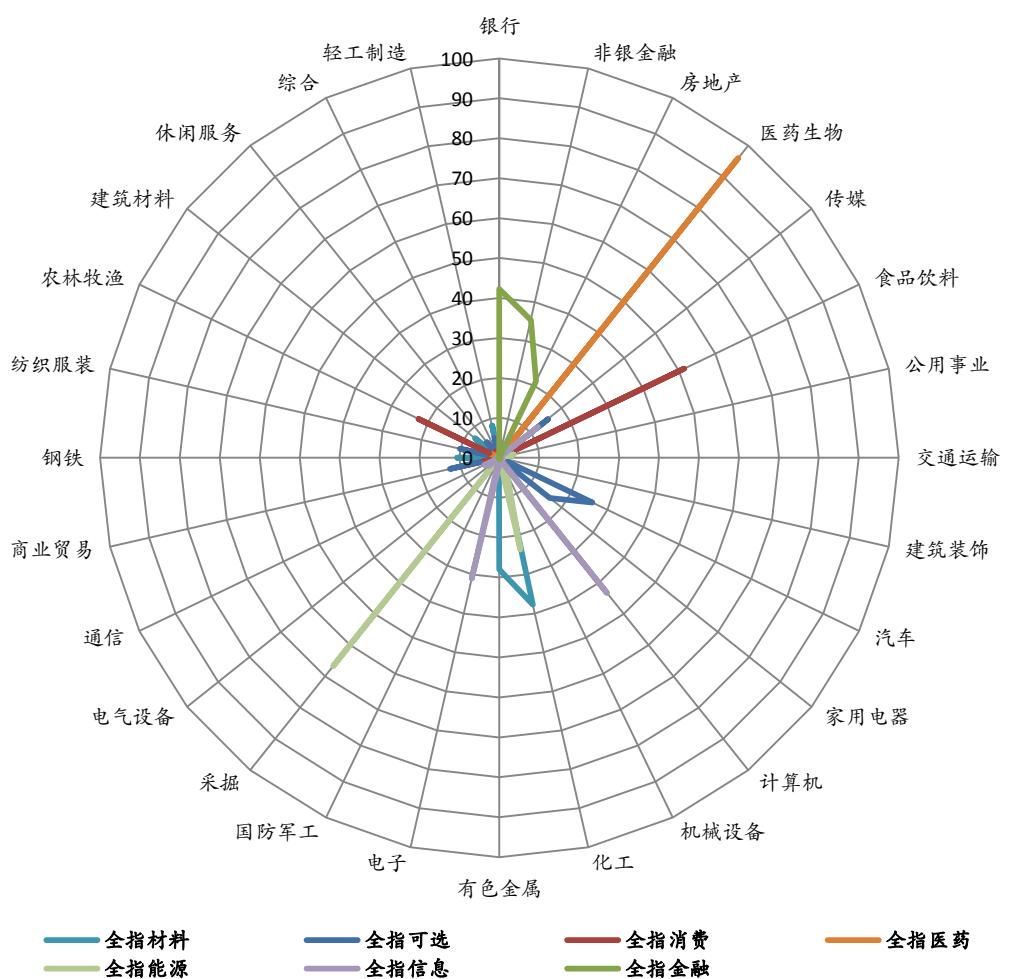


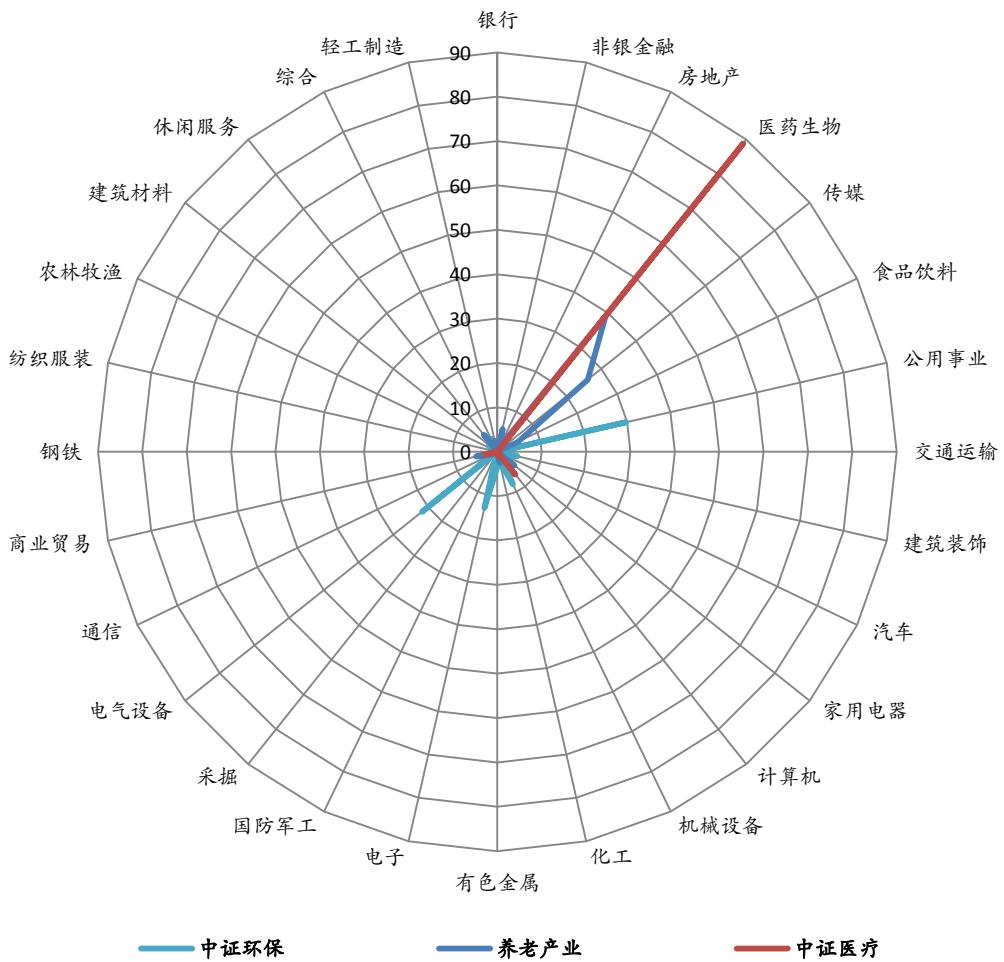
以巨潮数据库提供的权重数据计算，本月末银行业在沪深300指数中所占比重居首，为19.85%。医药生物、房地产和计算机行业在中证500指数中权重居前，依次为11.96%、7.38%和6.69%。计算机、医药生物和电子行业在中小300指数中权重居前，分别为12.98%、10.44%和10.36%。房地产、传媒和非银金融

行业在深证 100 指数中权重位列前三，依次为 12.33%、10.25% 和 9.41%。

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 0.456%。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 2.16%。

表 1 基金净值与跟踪误差

| 基金简称 | 2016 年 2 月 | | 2016 年 1 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 | 1.2686 | 1.5586 | 1.2967 | 1.5867 | 1.2029 | 2008/12/30 |
| 广发中证 500ETF 联接 | 1.1315 | 1.1315 | 1.1527 | 1.1527 | 1.7085 | 2009/11/26 |
| 广发中小板 300ETF | 1.2145 | 1.1034 | 1.2585 | 1.1434 | 0.4562 | 2011/6/3 |

| | | | | | | |
|--------------|--------|--------|--------|--------|--------|-----------|
| 广发中小板 300 联接 | 1.0152 | 1.0152 | 1.0512 | 1.0512 | 0.7409 | 2011/6/9 |
| 广发深证 100 分级 | 0.8433 | 0.9625 | 0.8777 | 0.9969 | 5.2939 | 2012/5/7 |
| 广发中证 500ETF | 1.4714 | 1.4714 | 1.5002 | 1.5002 | 1.1947 | 2013/4/11 |
| 广发全指可选消费 ETF | 1.2881 | 1.2881 | 1.3260 | 1.3260 | 0.6765 | 2014/6/3 |
| 广发全指医药卫生 ETF | 1.0719 | 1.0719 | 1.1026 | 1.1026 | 0.6757 | 2014/12/1 |
| 广发全指信息技术 ETF | 0.9855 | 0.9855 | 1.0298 | 1.0298 | 1.1389 | 2015/1/8 |
| 广发中证养老产业 | 0.8121 | 0.8121 | 0.8524 | 0.8524 | 0.5699 | 2015/2/13 |
| 广发全指金融地产 ETF | 0.6724 | 0.6724 | 0.6863 | 0.6863 | 0.6285 | 2015/3/23 |
| 广发中证环保产业 | 0.6232 | 0.6232 | 0.6403 | 0.6403 | 2.1624 | 2015/3/25 |
| 广发全指原材料 ETF | 0.6726 | 0.6726 | 0.6672 | 0.6672 | 0.7205 | 2015/6/25 |
| 广发全指能源 ETF | 0.5866 | 0.5866 | 0.5759 | 0.5759 | 0.1540 | 2015/6/25 |
| 广发全指主要消费 ETF | 0.7637 | 0.7637 | 0.7708 | 0.7708 | 0.7807 | 2015/7/1 |
| 广发中证医疗分级 | 0.9450 | 0.6228 | 1.0000 | 0.6584 | 6.9252 | 2015/7/23 |

数据来源：申万宏源研究。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

2月沪深两市先扬后抑，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 | 1973.01 | 1970.21 | 2064.61 | 1891.10 | 1944.61 | -1.44% | 4102.70 |
| 上证 180 | 6308.48 | 6295.27 | 6681.97 | 6051.99 | 6205.37 | -1.63% | 10267.86 |
| 深证成指 | 9418.20 | 9389.62 | 10397.52 | 9000.89 | 9097.36 | -3.41% | 22009.67 |
| 深证 100P | 3374.35 | 3363.52 | 3636.17 | 3214.38 | 3249.21 | -3.71% | 7530.05 |
| 中小板指 | 6272.91 | 6241.61 | 6861.78 | 5928.19 | 5998.28 | -4.38% | 4973.02 |
| 中小板 300 | 1295.64 | 1290.32 | 1447.15 | 1237.39 | 1250.52 | -3.48% | 10962.74 |
| 创业板指 | 1994.07 | 1989.21 | 2249.69 | 1866.25 | 1880.15 | -5.71% | 4797.37 |
| 沪深 300 | 2946.09 | 2939.04 | 3128.21 | 2821.21 | 2877.47 | -2.33% | 16813.60 |

| | | | | | | | |
|--------|---------|---------|---------|---------|---------|--------|----------|
| 中证 500 | 5469.13 | 5458.60 | 6118.64 | 5286.34 | 5350.43 | -2.17% | 14756.15 |
| 申万 A 指 | 3106.15 | 3097.43 | 3421.03 | 2991.37 | 3033.89 | -2.33% | 77696.96 |

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 | 1724.47 | 1719.80 | 1859.31 | 1643.15 | 1758.28 | 1.96% | 1359.13 |
| 全指材料 | 2641.47 | 2631.90 | 2990.52 | 2548.82 | 2663.54 | 0.84% | 10310.93 |
| 全指工业 | 3508.36 | 3500.94 | 3897.62 | 3322.12 | 3373.58 | -3.84% | 14300.10 |
| 全指可选 | 5005.81 | 4984.35 | 5560.53 | 4820.45 | 4875.51 | -2.60% | 10163.98 |
| 全指消费 | 6925.55 | 6914.48 | 7546.08 | 6759.81 | 6867.01 | -0.85% | 3046.29 |
| 全指医药 | 8371.13 | 8344.55 | 9222.62 | 8038.18 | 8137.19 | -2.79% | 3392.84 |
| 全指金融 | 4817.57 | 4808.27 | 5066.41 | 4601.23 | 4715.80 | -2.11% | 6852.28 |
| 全指信息 | 5649.64 | 5634.79 | 6444.99 | 5357.88 | 5404.66 | -4.34% | 12433.32 |
| 全指电信 | 5220.86 | 5203.56 | 5732.77 | 4881.22 | 4928.35 | -5.60% | 1576.19 |
| 全指公用 | 2314.32 | 2312.42 | 2511.26 | 2241.45 | 2277.13 | -1.61% | 1430.83 |
| 中证全指 | 4154.91 | 4143.35 | 4568.82 | 3998.71 | 4056.61 | -2.37% | 75256.54 |

图3 核心指数月度表现

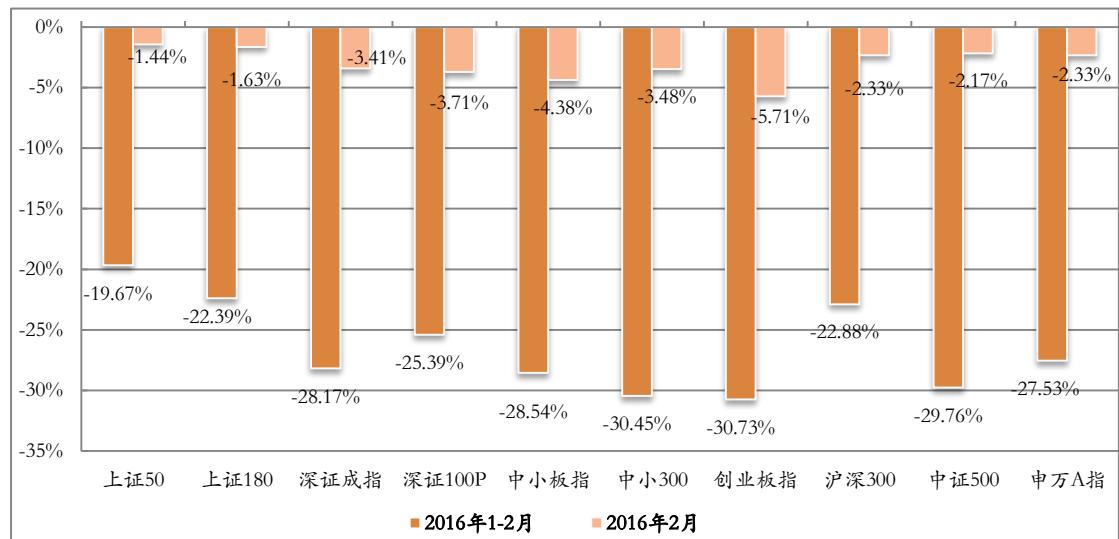


图4 核心指数本月绝对收益

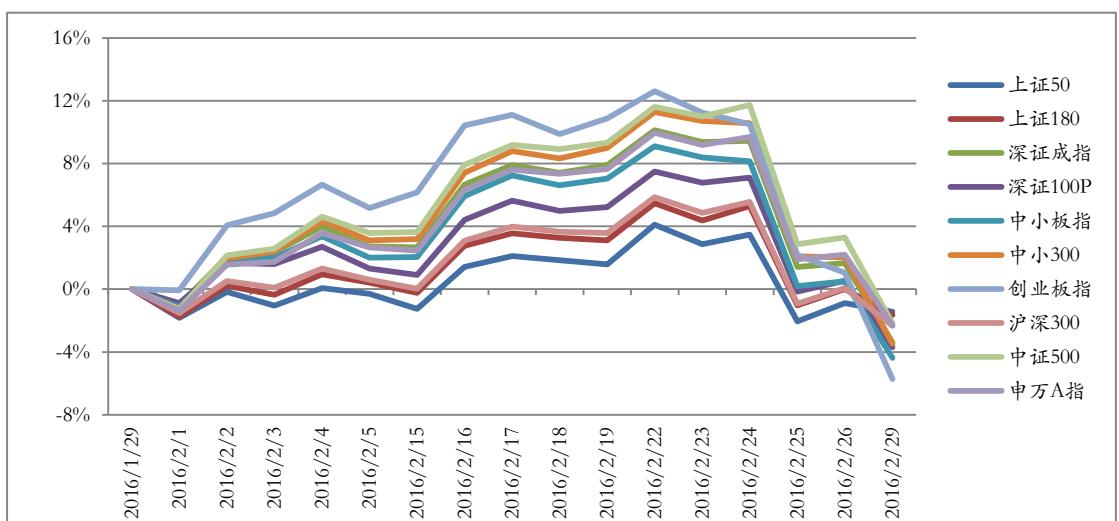
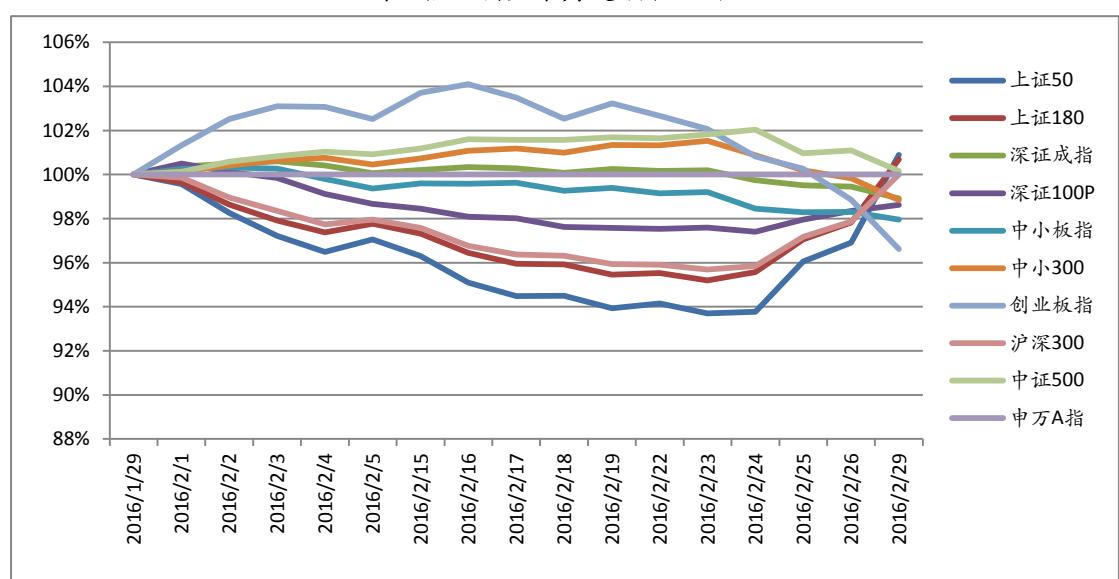


图5 核心指数本月超额收益对比



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

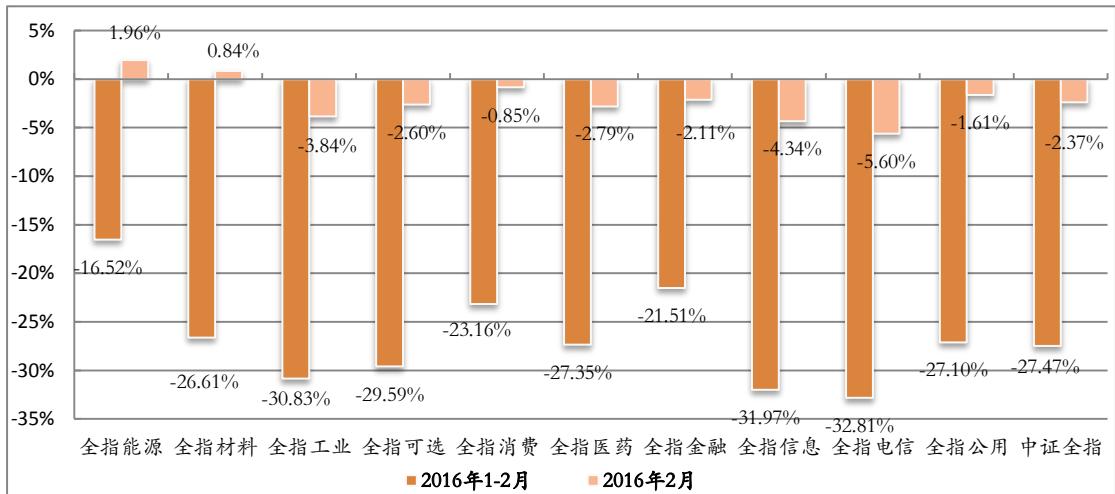


图 7 行业指数本月绝对收益

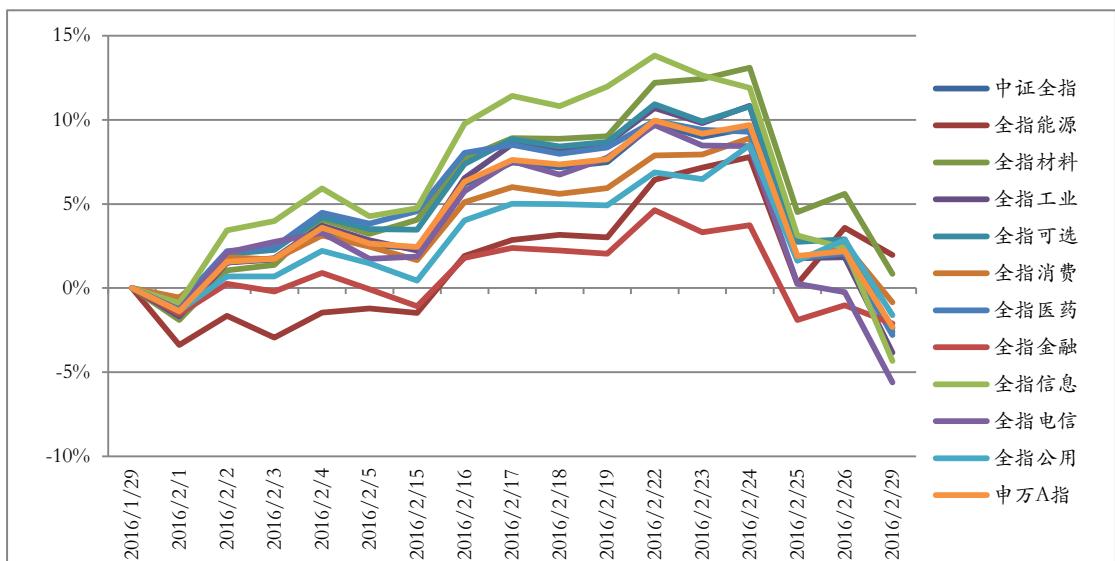
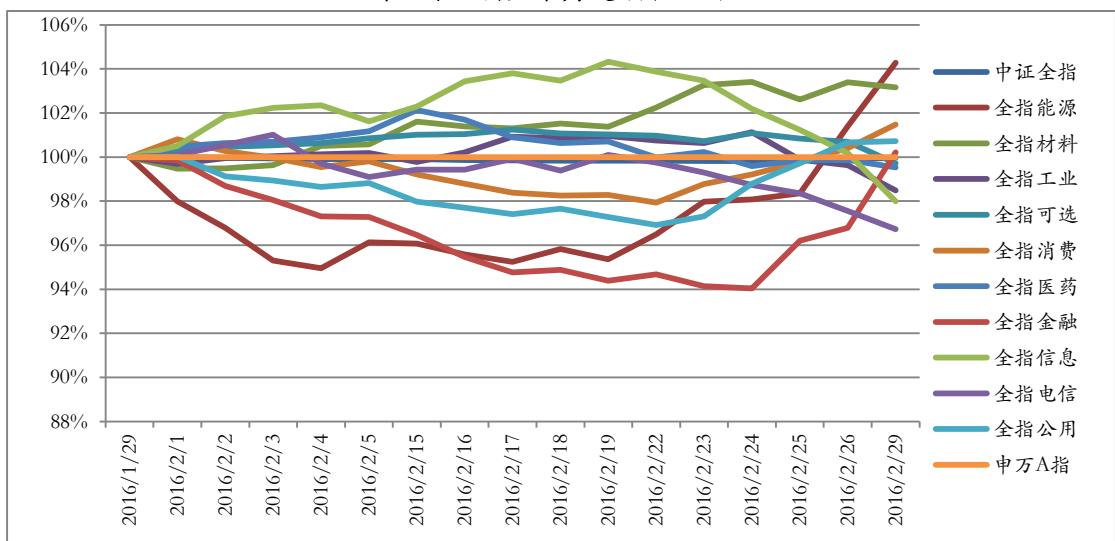


图 8 行业指数本月超额收益对比



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2月份核心指数的估值水平继续回落，市场平均动态（2016年）市盈率为12.72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8.06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 | 13.72 | 8.38 | 8.06 | 0.96 |
| 上证180 | 15.05 | 9.10 | 8.56 | 1.05 |
| 深证成指 | 45.73 | 24.65 | 18.95 | 2.78 |
| 深证100 | 31.95 | 17.40 | 15.04 | 2.31 |
| 中小板指 | 52.04 | 28.85 | 23.34 | 3.99 |
| 中小300 | 63.25 | 33.88 | 24.49 | 3.85 |
| 创业板指 | 115.30 | 47.25 | 29.73 | 7.07 |
| 沪深300 | 17.17 | 10.28 | 9.56 | 1.20 |
| 中证500 | 59.53 | 31.47 | 21.77 | 2.45 |
| 申万A指 | 25.79 | 15.28 | 12.72 | 1.67 |

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 | 34.00 | 27.56 | 24.13 | 0.88 |
| 全指材料 | 67.82 | 38.50 | 25.69 | 1.88 |
| 全指工业 | 46.10 | 23.78 | 17.59 | 1.97 |
| 全指可选 | 40.78 | 22.34 | 16.03 | 2.55 |
| 全指消费 | 42.66 | 26.02 | 18.92 | 3.08 |
| 全指医药 | 66.78 | 37.02 | 28.15 | 4.19 |
| 全指金融 | 11.75 | 7.16 | 6.78 | 1.04 |
| 全指信息 | 109.20 | 50.83 | 30.70 | 4.77 |
| 全指电信 | 78.19 | 35.83 | 24.08 | 1.59 |
| 全指公用 | 23.82 | 14.20 | 10.80 | 1.40 |
| 中证全指 | 25.54 | 15.15 | 12.63 | 1.65 |

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 | 29.01 | -3.88 | 7.25 | 9.53 |
| 600016 | 民生银行 | 8.45 | -0.78 | 4.56 | 7.57 |
| 601166 | 兴业银行 | 14.18 | -1.94 | 7.17 | 5.73 |
| 600000 | 浦发银行 | 18.45 | 9.17 | 4.28 | 5.22 |
| 600036 | 招商银行 | 14.56 | -2.87 | 4.95 | 4.55 |
| 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 | 18.45 | 9.17 | 4.28 | 8.53 |
| 600519 | 贵州茅台 | 214.91 | 7.11 | 8.74 | 4.23 |
| 601169 | 北京银行 | 9.61 | 3.00 | 6.79 | 1.67 |
| 600048 | 保利地产 | 9.08 | 4.25 | 22.80 | 1.41 |
| 600837 | 海通证券 | 12.40 | 2.39 | 15.75 | 1.38 |
| 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 |
| 600000 | 浦发银行 | 18.45 | 9.17 | 4.28 | 8.53 |
| 600519 | 贵州茅台 | 214.91 | 7.11 | 8.74 | 4.23 |
| 600585 | 海螺水泥 | 14.09 | 7.07 | 21.24 | 1.09 |
| 600048 | 保利地产 | 9.08 | 4.25 | 22.80 | 1.41 |
| 601169 | 北京银行 | 9.61 | 3.00 | 6.79 | 1.67 |
| 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 |
| 601390 | 中国中铁 | 7.29 | -8.42 | 22.20 | -2.21 |
| 601336 | 新华保险 | 33.82 | -8.15 | 46.32 | -1.10 |
| 600010 | 包钢股份 | 2.75 | -7.10 | 19.80 | -1.21 |
| 600999 | 招商证券 | 13.97 | -6.74 | 28.25 | -1.74 |
| 601669 | 中国电建 | 5.89 | -6.66 | 21.28 | -1.02 |

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 | 29.01 | -3.88 | 7.25 | 5.97 |
| 600016 | 民生银行 | 8.45 | -0.78 | 4.56 | 4.74 |
| 601166 | 兴业银行 | 14.18 | -1.94 | 7.17 | 3.59 |
| 600000 | 浦发银行 | 18.45 | 9.17 | 4.28 | 3.27 |
| 600036 | 招商银行 | 14.56 | -2.87 | 4.95 | 2.85 |
| 贡献前 5 名样本股 | | | | | |
| 代码 | 简称 | 收盘 | 涨跌幅% | 换手率% | 贡献点数 |
| 600000 | 浦发银行 | 18.45 | 9.17 | 4.28 | 17.05 |
| 600519 | 贵州茅台 | 214.91 | 7.11 | 8.74 | 8.44 |
| 600547 | 山东黄金 | 25.26 | 51.35 | 121.13 | 7.18 |
| 601600 | 中国铝业 | 4.50 | 19.69 | 43.84 | 4.78 |
| 601899 | 紫金矿业 | 3.13 | 12.18 | 32.29 | 3.79 |
| 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 |
| 600547 | 山东黄金 | 25.26 | 51.35 | 121.13 | 7.18 |
| 600489 | 中金黄金 | 10.20 | 26.71 | 63.09 | 3.75 |
| 600325 | 华发股份 | 12.20 | 26.03 | 52.03 | 2.06 |
| 600748 | 上实发展 | 11.01 | 19.93 | 77.95 | 0.91 |
| 601600 | 中国铝业 | 4.50 | 19.69 | 43.84 | 4.78 |
| 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 |
| 601018 | 宁波港 | 5.69 | -30.27 | 33.38 | -11.18 |
| 600690 | 青岛海尔 | 7.48 | -24.60 | 21.82 | -8.82 |
| 601198 | 东兴证券 | 19.28 | -14.62 | 149.00 | -1.97 |
| 600718 | 东软集团 | 16.01 | -14.39 | 52.19 | -2.71 |
| 600037 | 歌华有线 | 13.39 | -13.83 | 56.51 | -1.72 |

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 | 3.04 |
| 000651 | 格力电器 | 19.22 | 2.62 | 8.04 | 1.93 |
| 000001 | 平安银行 | 9.56 | -4.40 | 11.18 | 1.33 |
| 300104 | 乐视网 | 58.80 | 0.00 | 0.00 | 1.25 |
| 000725 | 京东方 A | 2.36 | 3.51 | 31.17 | 1.22 |
| 贡献前 5 名样本股 | | | | | |
| 代码 | 简称 | 收盘 | 涨跌幅% | 换手率% | 贡献点数 |
| 000060 | 中金岭南 | 11.50 | 27.07 | 63.23 | 6.57 |
| 002299 | 圣农发展 | 24.38 | 33.66 | 37.62 | 4.97 |
| 002001 | 新和成 | 19.00 | 35.62 | 103.57 | 4.86 |
| 002085 | 万丰奥威 | 29.30 | 26.84 | 20.76 | 4.67 |
| 000629 | 攀钢钒钛 | 3.30 | 22.68 | 61.46 | 4.59 |
| 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 |
| 000807 | 云铝股份 | 7.80 | 36.84 | 95.78 | 3.49 |
| 002001 | 新和成 | 19.00 | 35.62 | 103.57 | 4.86 |
| 002299 | 圣农发展 | 24.38 | 33.66 | 37.62 | 4.97 |
| 002714 | 牧原股份 | 54.06 | 30.11 | 59.21 | 3.80 |
| 002074 | 国轩高科 | 31.75 | 29.80 | 108.27 | 3.39 |
| 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 |
| 000973 | 佛塑科技 | 8.01 | -38.38 | 65.98 | -7.58 |
| 000901 | 航天科技 | 34.30 | -35.14 | 75.49 | -8.23 |
| 002269 | 美邦服饰 | 3.98 | -34.43 | 47.04 | -4.50 |
| 002465 | 海格通信 | 11.20 | -32.89 | 39.73 | -16.69 |
| 002011 | 盾安环境 | 11.79 | -29.49 | 38.16 | -4.97 |

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 | 6.75 |
| 000651 | 格力电器 | 19.22 | 2.62 | 8.04 | 4.27 |
| 000001 | 平安银行 | 9.56 | -4.40 | 11.18 | 2.94 |
| 300104 | 乐视网 | 58.80 | 0.00 | 0.00 | 2.77 |
| 000725 | 京东方 A | 2.36 | 3.51 | 31.17 | 2.71 |
| 贡献前 5 名样本股 | | | | | |
| 代码 | 简称 | 收盘 | 涨跌幅% | 换手率% | 贡献点数 |
| 000060 | 中金岭南 | 11.50 | 27.07 | 63.23 | 5.20 |
| 000629 | 攀钢钒钛 | 3.30 | 22.68 | 61.46 | 3.64 |
| 000651 | 格力电器 | 19.22 | 2.62 | 8.04 | 3.54 |
| 000725 | 京东方 A | 2.36 | 3.51 | 31.17 | 2.99 |
| 002594 | 比亚迪 | 50.51 | 6.14 | 32.95 | 2.43 |
| 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 |
| 000060 | 中金岭南 | 11.50 | 27.07 | 63.23 | 5.20 |
| 000629 | 攀钢钒钛 | 3.30 | 22.68 | 61.46 | 3.64 |
| 000031 | 中粮地产 | 10.56 | 10.46 | 80.46 | 1.65 |
| 002292 | 奥飞动漫 | 33.97 | 10.29 | 195.09 | 2.14 |
| 300498 | 温氏股份 | 47.71 | 10.13 | 30.51 | 1.89 |
| 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 |
| 002465 | 海格通信 | 11.20 | -32.89 | 39.73 | -13.21 |
| 002673 | 西部证券 | 19.22 | -20.41 | 96.27 | -7.82 |
| 300027 | 华谊兄弟 | 22.67 | -15.97 | 67.03 | -5.21 |
| 000686 | 东北证券 | 11.28 | -15.57 | 46.35 | -3.93 |
| 300070 | 碧水源 | 33.70 | -14.14 | 23.89 | -5.16 |

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 | 10.28 | -3.38 | 28.54 | 3.96 |
| 002450 | 康得新 | 29.90 | 0.00 | 0.00 | 3.40 |
| 002415 | 海康威视 | 27.74 | 4.48 | 26.46 | 3.23 |
| 002304 | 洋河股份 | 57.31 | -2.55 | 10.47 | 2.80 |
| 002594 | 比亚迪 | 50.51 | 6.14 | 32.95 | 2.45 |
| 贡献前 5 名样本股 | | | | | |
| 代码 | 简称 | 收盘 | 涨跌幅% | 换手率% | 贡献点数 |
| 002299 | 圣农发展 | 24.38 | 33.66 | 37.62 | 13.75 |
| 002001 | 新和成 | 19.00 | 35.62 | 103.57 | 13.46 |
| 002594 | 比亚迪 | 50.51 | 6.14 | 32.95 | 8.48 |
| 002415 | 海康威视 | 27.74 | 4.48 | 26.46 | 8.30 |
| 002285 | 世联行 | 12.56 | 24.60 | 83.61 | 8.23 |
| 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 |
| 002001 | 新和成 | 19.00 | 35.62 | 103.57 | 13.46 |
| 002299 | 圣农发展 | 24.38 | 33.66 | 37.62 | 13.75 |
| 002285 | 世联行 | 12.56 | 24.60 | 83.61 | 8.23 |
| 002280 | 联络互动 | 41.40 | 19.17 | 114.99 | 8.21 |
| 002092 | 中泰化学 | 6.64 | 11.41 | 47.02 | 3.89 |
| 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 |
| 002269 | 美邦服饰 | 3.98 | -34.43 | 47.04 | -12.45 |
| 002465 | 海格通信 | 11.20 | -32.89 | 39.73 | -46.19 |
| 002011 | 盾安环境 | 11.79 | -29.49 | 38.16 | -13.76 |
| 002368 | 太极股份 | 29.64 | -24.00 | 61.60 | -11.29 |
| 002261 | 拓维信息 | 25.50 | -22.33 | 62.29 | -12.55 |

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 | 10.28 | -3.38 | 28.54 | 2.15 |
| 002450 | 康得新 | 29.90 | 0.00 | 0.00 | 1.85 |
| 002415 | 海康威视 | 27.74 | 4.48 | 26.46 | 1.75 |
| 002304 | 洋河股份 | 57.31 | -2.55 | 10.47 | 1.52 |
| 002594 | 比亚迪 | 50.51 | 6.14 | 32.95 | 1.33 |
| 贡献前 5 名样本股 | | | | | |
| 代码 | 简称 | 收盘 | 涨跌幅% | 换手率% | 贡献点数 |
| 002299 | 圣农发展 | 24.38 | 33.66 | 37.62 | 1.56 |
| 002001 | 新和成 | 19.00 | 35.62 | 103.57 | 1.52 |
| 002085 | 万丰奥威 | 29.30 | 26.84 | 20.76 | 1.46 |
| 002714 | 牧原股份 | 54.06 | 30.11 | 59.21 | 1.19 |
| 002019 | 亿帆鑫富 | 48.90 | 27.94 | 119.52 | 1.14 |
| 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 |
| 002001 | 新和成 | 19.00 | 35.62 | 103.57 | 1.52 |
| 002299 | 圣农发展 | 24.38 | 33.66 | 37.62 | 1.56 |
| 002714 | 牧原股份 | 54.06 | 30.11 | 59.21 | 1.19 |
| 002074 | 国轩高科 | 31.75 | 29.80 | 108.27 | 1.06 |
| 002019 | 亿帆鑫富 | 48.90 | 27.94 | 119.52 | 1.14 |
| 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 |
| 002269 | 美邦服饰 | 3.98 | -34.43 | 47.04 | -1.41 |
| 002465 | 海格通信 | 11.20 | -32.89 | 39.73 | -5.23 |
| 002011 | 盾安环境 | 11.79 | -29.49 | 38.16 | -1.56 |
| 002622 | 永大集团 | 17.51 | -26.58 | 63.92 | -1.01 |
| 002368 | 太极股份 | 29.64 | -24.00 | 61.60 | -1.28 |

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 | 7.08 |
| 300059 | 东方财富 | 33.18 | -13.93 | 91.14 | 4.63 |
| 300017 | 网宿科技 | 51.91 | -0.56 | 37.56 | 2.97 |
| 300024 | 机器人 | 44.01 | -10.95 | 51.47 | 2.64 |
| 300070 | 碧水源 | 33.70 | -14.14 | 23.89 | 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 |
| 300113 | 顺网科技 | 78.10 | 15.69 | 91.11 | 3.85 |
| 300142 | 沃森生物 | 10.89 | 17.98 | 19.97 | 3.83 |
| 300498 | 温氏股份 | 47.71 | 10.13 | 30.51 | 2.79 |
| 300226 | 上海钢联 | 45.82 | 24.41 | 57.32 | 2.30 |
| 300347 | 泰格医药 | 28.60 | 12.69 | 9.01 | 2.02 |
| 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 |
| 300226 | 上海钢联 | 45.82 | 24.41 | 57.32 | 2.30 |
| 300142 | 沃森生物 | 10.89 | 17.98 | 19.97 | 3.83 |
| 300113 | 顺网科技 | 78.10 | 15.69 | 91.11 | 3.85 |
| 300347 | 泰格医药 | 28.60 | 12.69 | 9.01 | 2.02 |
| 300498 | 温氏股份 | 47.71 | 10.13 | 30.51 | 2.79 |
| 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 |
| 300288 | 朗玛信息 | 30.68 | -16.17 | 55.91 | -1.52 |
| 300352 | 北信源 | 26.67 | -16.13 | 126.39 | -1.66 |
| 300027 | 华谊兄弟 | 22.67 | -15.97 | 67.03 | -7.69 |
| 300244 | 迪安诊断 | 45.03 | -15.04 | 37.53 | -3.04 |
| 300133 | 华策影视 | 18.00 | -14.69 | 33.43 | -2.99 |

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 | 29.01 | -3.88 | 7.25 | 4.14 |
| 600016 | 民生银行 | 8.45 | -0.78 | 4.56 | 3.29 |
| 000002 | 万科 A | 24.43 | 0.00 | 0.00 | 2.50 |
| 601166 | 兴业银行 | 14.18 | -1.94 | 7.17 | 2.49 |
| 600000 | 浦发银行 | 18.45 | 9.17 | 4.28 | 2.27 |
| 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 | 18.45 | 9.17 | 4.28 | 5.48 |
| 600519 | 贵州茅台 | 214.91 | 7.11 | 8.74 | 2.71 |
| 600547 | 山东黄金 | 25.26 | 51.35 | 121.13 | 2.32 |
| 601600 | 中国铝业 | 4.50 | 19.69 | 43.84 | 1.53 |
| 000060 | 中金岭南 | 11.50 | 27.07 | 63.23 | 1.23 |
| 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 |
| 600547 | 山东黄金 | 25.26 | 51.35 | 121.13 | 2.32 |
| 600549 | 厦门钨业 | 17.59 | 28.11 | 83.12 | 0.65 |
| 000060 | 中金岭南 | 11.50 | 27.07 | 63.23 | 1.23 |
| 600489 | 中金黄金 | 10.20 | 26.71 | 63.09 | 1.20 |
| 000629 | 攀钢钒钛 | 3.30 | 22.68 | 61.46 | 1.02 |
| 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 |
| 002465 | 海格通信 | 11.20 | -32.89 | 39.73 | -3.55 |
| 601018 | 宁波港 | 5.69 | -30.27 | 33.38 | -3.60 |
| 600690 | 青岛海尔 | 7.48 | -24.60 | 21.82 | -2.84 |
| 600578 | 京能电力 | 4.62 | -23.89 | 16.98 | -0.75 |
| 002673 | 西部证券 | 19.22 | -20.41 | 96.27 | -2.07 |

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 | 0.75 |
| 600654 | 中安消 | 28.84 | 0.00 | 0.00 | 0.73 |
| 002466 | 天齐锂业 | 119.39 | 2.04 | 167.75 | 0.62 |
| 600122 | 宏图高科 | 19.42 | 0.00 | 0.00 | 0.59 |
| 000718 | 苏宁环球 | 13.19 | 0.00 | 0.00 | 0.53 |
| 贡献前 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 | 29.30 | 26.84 | 20.76 | 4.99 |
| 002001 | 新和成 | 19.00 | 35.62 | 103.57 | 4.81 |
| 002299 | 圣农发展 | 24.38 | 33.66 | 37.62 | 4.77 |
| 600219 | 南山铝业 | 6.71 | 17.31 | 58.69 | 3.46 |
| 002714 | 牧原股份 | 54.06 | 30.11 | 59.21 | 3.43 |
| 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 |
| 002001 | 新和成 | 19.00 | 35.62 | 103.57 | 4.81 |
| 000703 | 恒逸石化 | 12.43 | 34.81 | 57.03 | 2.26 |
| 002299 | 圣农发展 | 24.38 | 33.66 | 37.62 | 4.77 |
| 002180 | 艾派克 | 44.28 | 30.35 | 22.15 | 3.11 |
| 002714 | 牧原股份 | 54.06 | 30.11 | 59.21 | 3.43 |
| 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 |
| 000973 | 佛塑科技 | 8.01 | -38.38 | 65.98 | -6.77 |
| 002269 | 美邦服饰 | 3.98 | -34.43 | 47.04 | -4.65 |
| 002011 | 盾安环境 | 11.79 | -29.49 | 38.16 | -4.43 |
| 002368 | 太极股份 | 29.64 | -24.00 | 61.60 | -3.36 |
| 601000 | 唐山港 | 6.31 | -23.51 | 33.56 | -3.11 |

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 | 29.01 | -3.88 | 7.25 | 1.87 |
| 600016 | 民生银行 | 8.45 | -0.78 | 4.56 | 1.35 |
| 601166 | 兴业银行 | 14.18 | -1.94 | 7.17 | 1.11 |
| 600036 | 招商银行 | 14.56 | -2.87 | 4.95 | 0.90 |
| 000002 | 万科 A | 24.43 | 0.00 | 0.00 | 0.86 |
| 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 | 18.45 | 9.17 | 4.28 | 2.00 |
| 600519 | 贵州茅台 | 214.91 | 7.11 | 8.74 | 1.29 |
| 600547 | 山东黄金 | 25.26 | 51.35 | 121.13 | 1.21 |
| 600489 | 中金黄金 | 10.20 | 26.71 | 63.09 | 0.65 |
| 000060 | 中金岭南 | 11.50 | 27.07 | 63.23 | 0.63 |
| 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 |
| 600234 | 山水文化 | 22.22 | 90.40 | 121.66 | 0.35 |
| 300459 | 浙江金科 | 28.70 | 58.13 | 402.47 | 0.14 |
| 002103 | 广博股份 | 26.97 | 53.94 | 95.43 | 0.20 |
| 600547 | 山东黄金 | 25.26 | 51.35 | 121.13 | 1.21 |
| 000019 | 深深宝 A | 18.30 | 48.90 | 438.92 | 0.20 |
| 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 |
| 002473 | 圣莱达 | 18.43 | -44.15 | 196.80 | -0.17 |
| 000973 | 佛塑科技 | 8.01 | -38.38 | 65.98 | -0.73 |
| 000901 | 航天科技 | 34.30 | -35.14 | 75.49 | -0.75 |
| 002269 | 美邦服饰 | 3.98 | -34.43 | 47.04 | -0.43 |
| 300351 | 永贵电器 | 20.76 | -33.67 | 73.63 | -0.22 |

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。