

广发基金指数月报

(2016年3月1日—2016年3月31日)

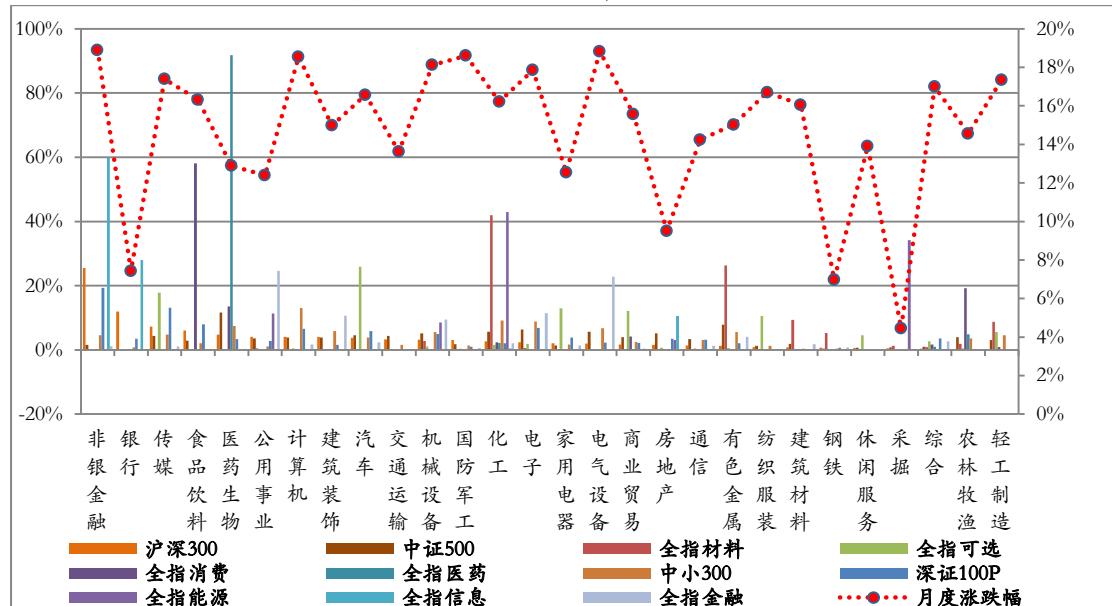
广发基金数量投资部

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

本月市场止跌反弹，申万28个一级行业全部上涨，非银金融、电气设备、国防军工、计算机和机械设备行业的涨幅均超过18%，采掘和钢铁行业涨幅不到7%。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25.5%；医药生物行业对中证500指数贡献最大，贡献率为11.6%；计算机行业对中小300指数贡献居首，贡献率为13.0%；非银金融行业对深证100指数贡献最大，贡献率为19.3%。

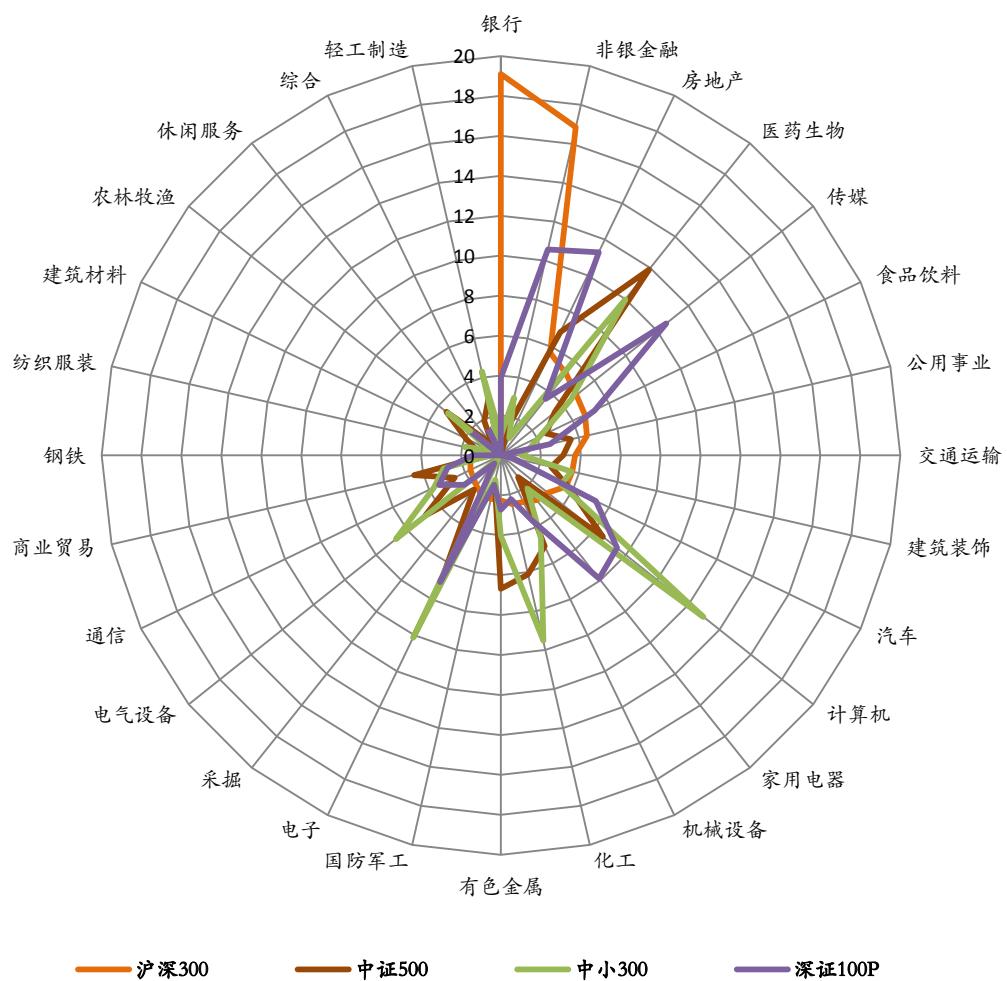
图1 成份行业贡献率与月度涨跌幅

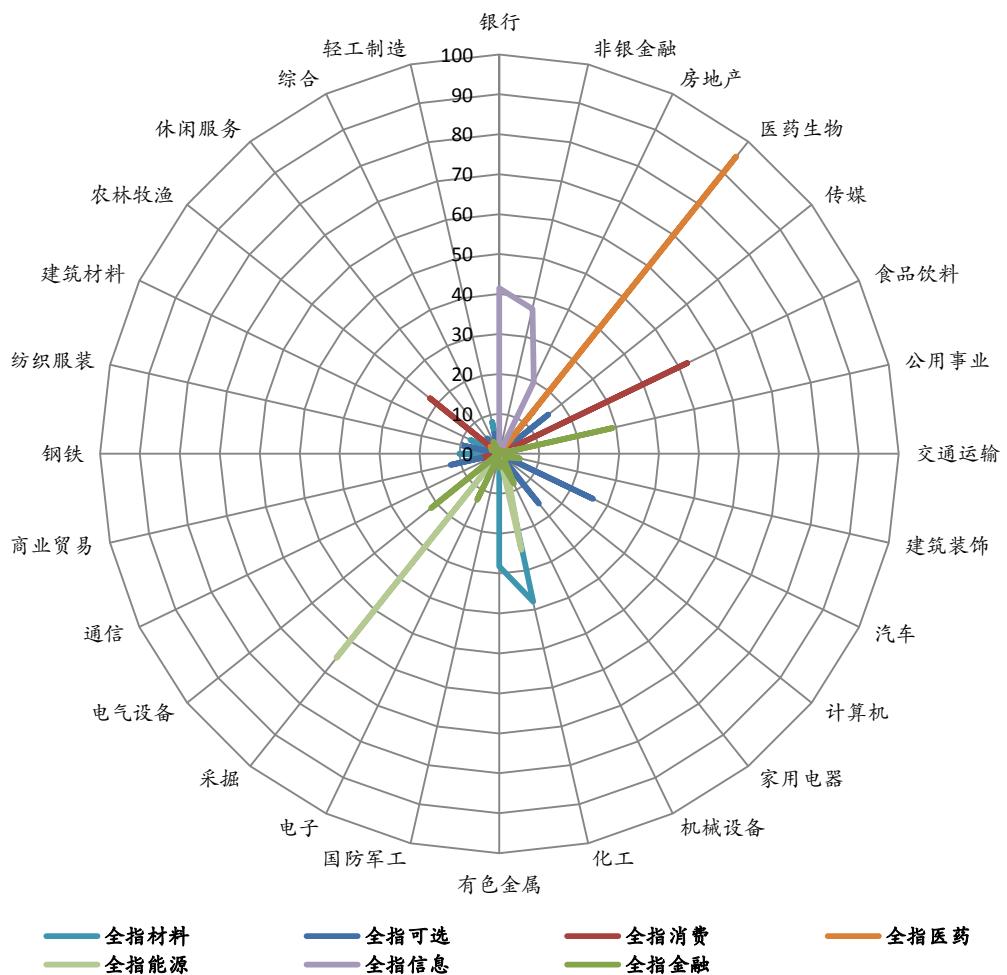


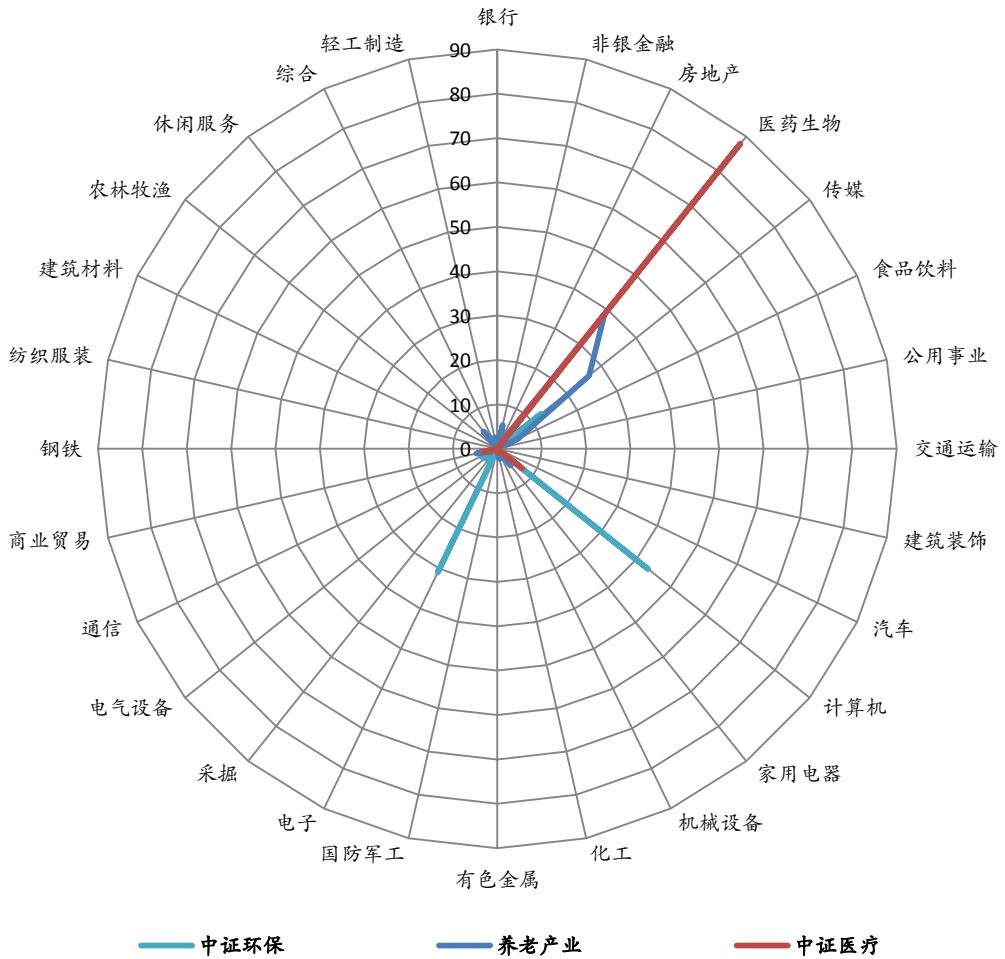
以巨潮数据库提供的权重数据计算，本月末银行业在沪深300指数中所占比重居首，为19.09%。医药生物、房地产和有色金属行业在中证500指数中权重居前，依次为11.9%、6.86%和6.68%。计算机、电子和医药生物行业在中小300指数中权重居前，分别为12.98%、10.14%和9.99%。房地产、传媒和非银金融

行业在深证 100 指数中权重位列前三，依次为 11.28%、10.59% 和 10.57%。

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 0.442%。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 1.62%，跟踪效果较好。

表 1 基金净值与跟踪误差

基金简称	2016 年 3 月		2016 年 2 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	1.4169	1.7069	1.2686	1.5586	0.7932	2008/12/30
广发中证 500ETF 联接	1.2878	1.2878	1.1315	1.1315	1.0500	2009/11/26

广发中小板 300ETF	1.4233	1.2931	1.2145	1.1034	0.4416	2011/6/3
广发中小板 300 联接	1.1810	1.1810	1.0152	1.0152	0.6022	2011/6/9
广发深证 100 分级	0.9681	1.0873	0.8433	0.9625	4.3055	2012/5/7
广发中证 500ETF	1.6874	1.6874	1.4714	1.4714	0.6955	2013/4/11
广发全指可选消费 ETF	1.4935	1.4935	1.2881	1.2881	0.4234	2014/6/3
广发全指医药卫生 ETF	1.2070	1.2070	1.0719	1.0719	0.4732	2014/12/1
广发全指信息技术 ETF	1.1537	1.1537	0.9855	0.9855	0.7090	2015/1/8
广发中证养老产业	0.9349	0.9349	0.8121	0.8121	0.3643	2015/2/13
广发全指金融地产 ETF	0.7460	0.7460	0.6724	0.6724	0.4908	2015/3/23
广发中证环保产业	0.7230	0.7230	0.6232	0.6232	1.6176	2015/3/25
广发全指原材料 ETF	0.7676	0.7676	0.6726	0.6726	0.3404	2015/6/25
广发全指能源 ETF	0.6241	0.6241	0.5866	0.5866	0.1457	2015/6/25
广发全指主要消费 ETF	0.8737	0.8737	0.7637	0.7637	0.5159	2015/7/1
广发中证医疗分级	1.1216	0.7370	0.9450	0.6228	3.9570	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

3 月沪深两市止跌上行，覆盖两市的申万 A 指上涨 14.75%。指数方面，本期核心市场指数中，创业板指涨幅最大，上涨 19.1%；上证 50 表现最差，涨幅为 10.9%。

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	1944.61	1944.56	2214.64	1931.98	2156.54	10.90%	9364.65
上证 180	6205.37	6210.22	7068.31	6166.85	6921.88	11.55%	21161.94
深证成指	9097.36	9116.56	10552.58	9011.51	10455.37	14.93%	38142.17
深证 100P	3249.21	3258.92	3715.64	3237.39	3681.69	13.31%	12913.43
中小板指	5998.28	5999.78	6923.55	5929.62	6864.80	14.45%	8546.67
中小板 300	1250.52	1251.69	1480.55	1233.27	1466.29	17.25%	19249.48

创业板指	1880.15	1881.32	2277.92	1841.22	2238.29	19.05%	8612.58
沪深 300	2877.47	2881.34	3267.78	2863.32	3218.09	11.84%	32684.58
中证 500	5350.43	5361.79	6211.14	5294.54	6155.81	15.05%	25088.47
申万 A 指	3033.89	3036.16	3511.27	3000.44	3481.39	14.75%	133115.08

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	1758.28	1751.21	1944.17	1738.58	1872.67	6.51%	2131.39
全指材料	2663.54	2667.86	3067.91	2647.11	3047.67	14.42%	18835.27
全指工业	3373.58	3384.60	3960.89	3328.04	3922.85	16.28%	23289.71
全指可选	4875.51	4873.57	5712.30	4809.32	5656.34	16.02%	16266.52
全指消费	6867.01	6873.54	7965.79	6821.98	7887.16	14.86%	5304.92
全指医药	8137.19	8147.63	9268.44	8024.65	9190.63	12.95%	5592.86
全指金融	4715.80	4720.83	5392.83	4695.10	5247.75	11.28%	15210.17
全指信息	5404.66	5392.13	6442.84	5256.06	6362.14	17.72%	21617.04
全指电信	4928.35	4944.16	5740.88	4830.37	5673.60	15.12%	2570.15
全指公用	2277.13	2283.59	2556.15	2254.58	2540.39	11.56%	2290.43
中证全指	4056.61	4059.91	4689.75	4012.13	4650.48	14.64%	129306.20

图3 核心指数月度表现

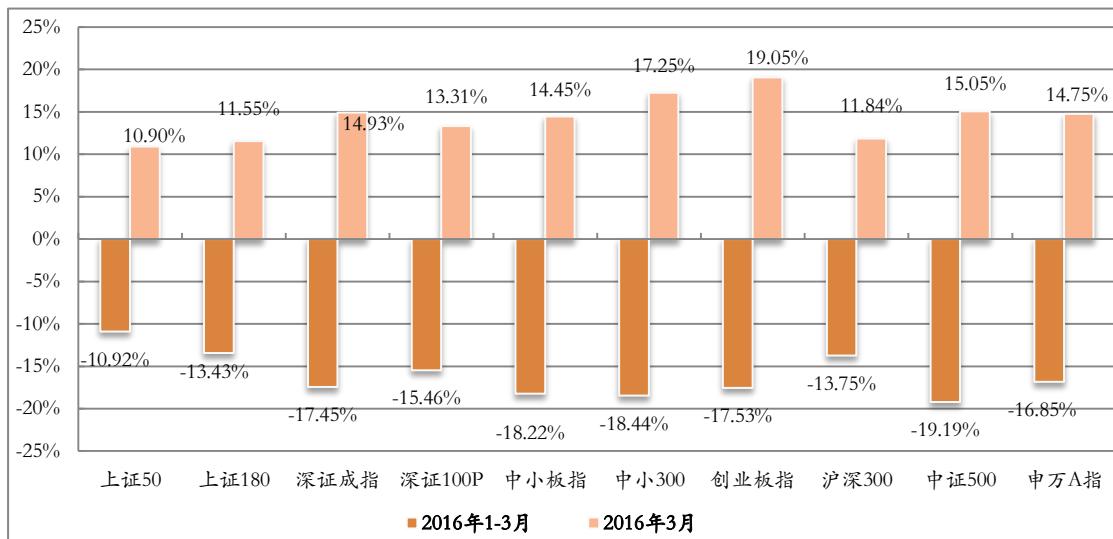


图4 核心指数本月绝对收益

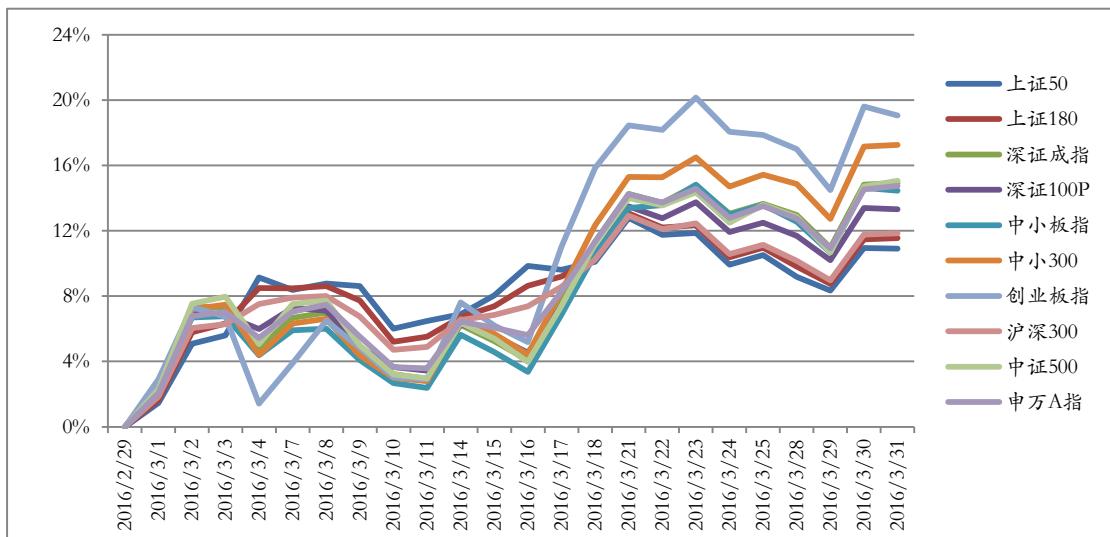
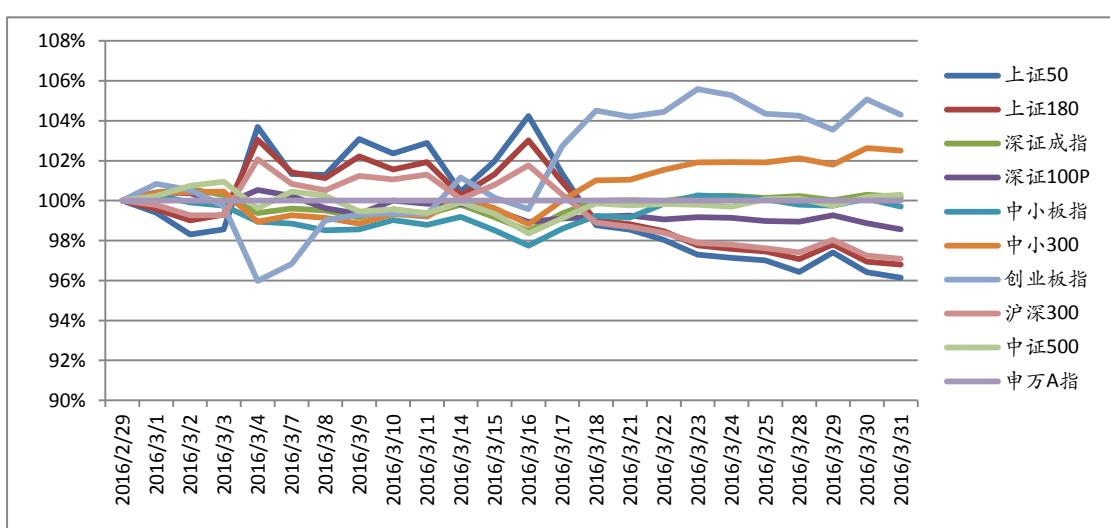


图5 核心指数本月超额收益对比



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

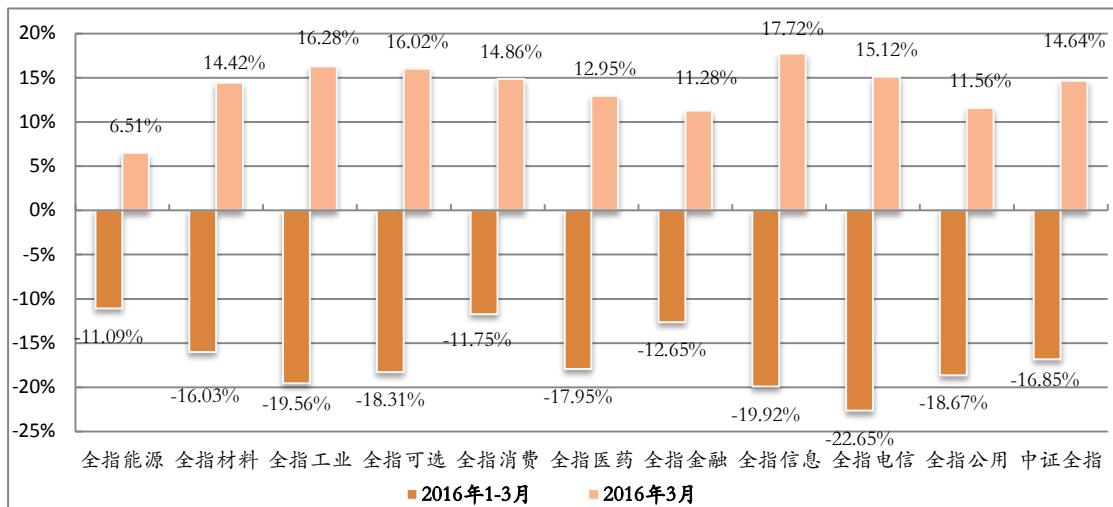


图 7 行业指数本月绝对收益

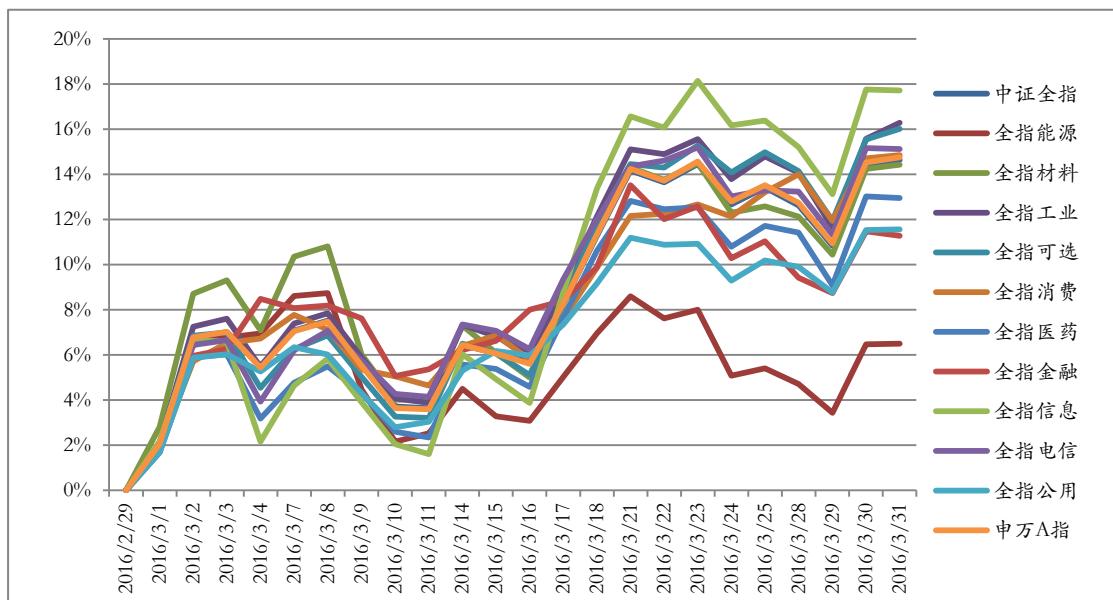
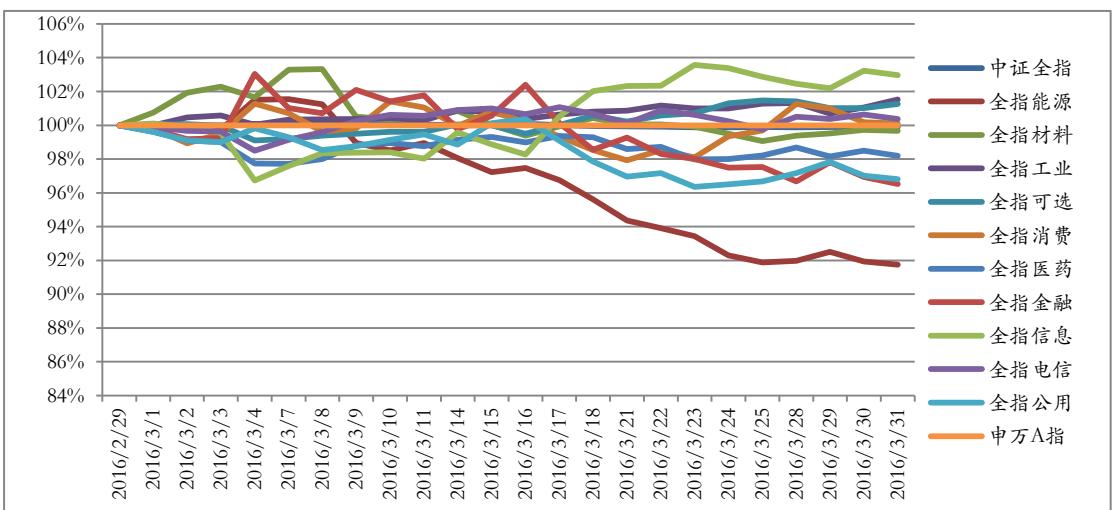


图 8 行业指数本月超额收益对比



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3月份核心指数的估值水平小幅回升，市场平均动态（2016年）市盈率为15.01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9.14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	15.29	9.17	9.14	1.07
上证180	16.81	10.08	9.76	1.18
深证成指	53.68	28.43	22.51	3.25
深证100	36.80	19.71	17.65	2.65
中小板指	60.51	33.11	26.44	4.63
中小300	75.12	39.60	28.49	4.57
创业板指	142.24	57.75	36.43	8.83
沪深300	19.29	11.43	10.97	1.35
中证500	69.87	36.49	25.43	2.87
申万A指	29.72	17.52	15.01	1.92

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	36.50	28.23	27.69	0.94
全指材料	78.81	47.35	30.87	2.18
全指工业	54.15	28.15	21.13	2.32
全指可选	48.09	25.89	19.08	3.00
全指消费	49.71	29.14	22.46	3.58
全指医药	76.50	42.19	32.34	4.80
全指金融	13.19	7.93	7.76	1.16
全指信息	131.43	59.66	37.30	5.72
全指电信	90.03	40.06	28.99	1.84
全指公用	27.22	15.65	12.78	1.61
中证全指	29.42	17.32	14.88	1.90

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	31.81	9.65	15.09	9.40
600016	民生银行	9.11	7.81	11.29	7.34
601166	兴业银行	15.53	9.52	16.24	5.65
600000	浦发银行	17.93	-2.82	10.79	4.81
600036	招商银行	16.09	10.51	11.41	4.53
贡献前 5 名样本股					
代码	简称	收盘	涨跌幅%	换手率%	贡献点数
601318	中国平安	31.81	9.65	15.09	17.89
600030	中信证券	17.80	24.65	69.27	16.35
600016	民生银行	9.11	7.81	11.29	11.50
601166	兴业银行	15.53	9.52	16.24	10.62
600519	贵州茅台	247.64	15.23	19.70	9.68
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
600999	招商证券	17.89	28.06	68.25	6.72
600109	国金证券	14.43	26.91	114.83	3.28
601688	华泰证券	17.11	25.53	58.77	6.72
600030	中信证券	17.80	24.65	69.27	16.35
601901	方正证券	7.92	24.33	78.87	3.75
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
600000	浦发银行	17.93	-2.82	10.79	-2.93
600048	保利地产	9.28	2.20	57.03	0.76
601088	中国神华	14.06	3.15	27.39	0.50
601857	中国石油	7.61	4.53	36.36	0.95
601169	北京银行	10.08	4.89	21.04	2.82

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	31.81	9.65	15.09	5.86
600016	民生银行	9.11	7.81	11.29	4.58
601166	兴业银行	15.53	9.52	16.24	3.52
600000	浦发银行	17.93	-2.82	10.79	3.00
600036	招商银行	16.09	10.51	11.41	2.82
贡献前 5 名样本股					
代码	简称	收盘	涨跌幅%	换手率%	贡献点数
601318	中国平安	31.81	9.65	15.09	35.78
600030	中信证券	17.80	24.65	69.27	32.70
600016	民生银行	9.11	7.81	11.29	22.99
601166	兴业银行	15.53	9.52	16.24	21.22
600519	贵州茅台	247.64	15.23	19.70	19.38
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
600570	恒生电子	58.34	67.60	248.51	13.70
600633	浙报传媒	17.10	41.21	150.65	3.52
601198	东兴证券	26.99	39.99	184.64	4.57
601555	东吴证券	13.41	35.73	143.98	8.68
600316	洪都航空	20.78	35.20	126.77	2.74
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
600383	金地集团	11.62	-18.63	41.91	-7.05
600000	浦发银行	17.93	-2.82	10.79	-5.83
601600	中国铝业	4.39	-2.44	58.93	-0.68
600645	中源协和	39.34	-1.77	134.28	-0.26
600748	上实发展	11.02	0.09	110.87	-0.02

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	2.65
000651	格力电器	19.22	0.00	0.00	1.68
000001	平安银行	10.64	11.30	21.45	1.29
000333	美的集团	30.85	18.33	19.05	1.21
000725	京东方 A	2.55	8.05	35.46	1.15
贡献前 5 名样本股					
代码	简称	收盘	涨跌幅%	换手率%	贡献点数
300059	东方财富	44.30	33.51	214.05	24.95
000776	广发证券	16.72	30.63	73.55	22.76
000858	五粮液	28.11	25.16	41.30	19.98
000333	美的集团	30.85	18.33	19.05	19.62
002673	西部证券	27.02	40.58	256.61	15.63
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
002431	棕榈园林	31.80	87.39	690.03	6.60
300228	富瑞特装	27.91	62.17	246.67	4.13
300052	中青宝	26.45	60.50	435.58	3.17
002174	游族网络	117.38	55.86	205.15	5.75
002280	联络互动	25.30	53.19	250.87	9.79
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
000066	长城电脑	14.10	-34.54	106.49	-9.63
000748	长城信息	23.55	-32.48	112.07	-15.63
002049	同方国芯	43.64	-27.45	101.32	-10.58
300238	冠昊生物	43.00	-24.12	16.12	-4.87
000876	新希望	16.08	-15.32	86.20	-5.78

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	5.95
000651	格力电器	19.22	0.00	0.00	3.77
000001	平安银行	10.64	11.30	21.45	2.89
000333	美的集团	30.85	18.33	19.05	2.72
000725	京东方 A	2.55	8.05	35.46	2.59
贡献前 5 名样本股					
代码	简称	收盘	涨跌幅%	换手率%	贡献点数
300059	东方财富	44.30	33.51	214.05	19.75
000776	广发证券	16.72	30.63	73.55	18.02
000858	五粮液	28.11	25.16	41.30	15.82
000333	美的集团	30.85	18.33	19.05	15.53
002673	西部证券	27.02	40.58	256.61	12.37
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
000839	中信国安	17.78	49.16	177.86	9.80
000750	国海证券	11.68	42.27	135.93	7.76
002673	西部证券	27.02	40.58	256.61	12.37
002081	金螳螂	17.08	40.00	89.44	6.72
300058	蓝色光标	10.58	34.61	69.17	5.67
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
000876	新希望	16.08	-15.32	86.20	-4.58
000738	中航动控	29.25	-6.94	168.83	-1.50
000629	攀钢钒钛	3.16	-4.24	132.54	-0.83
000060	中金岭南	11.17	-2.87	110.73	-0.70
000709	河钢股份	3.05	1.33	83.86	0.28

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	11.45	11.38	48.99	3.86
002450	康得新	32.99	10.33	35.31	3.28
002415	海康威视	30.82	11.10	29.84	3.13
002304	洋河股份	66.80	16.56	21.55	2.85
002594	比亚迪	58.81	16.43	48.95	2.49
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	27.02	40.58	256.61	43.24
002736	国信证券	16.42	21.63	38.84	28.24
002304	洋河股份	66.80	16.56	21.55	27.83
002456	欧菲光	26.54	34.04	97.88	27.52
002280	联络互动	25.30	53.19	250.87	27.10
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
002280	联络互动	25.30	53.19	250.87	27.10
002657	中科金财	63.47	43.69	234.72	16.25
002673	西部证券	27.02	40.58	256.61	43.24
002081	金螳螂	17.08	40.00	89.44	23.50
002456	欧菲光	26.54	34.04	97.88	27.52
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
002049	同方国芯	43.64	-27.45	101.32	-29.29
002252	上海莱士	38.17	-0.78	21.69	-0.92
002276	万马股份	20.87	1.95	203.84	1.13
002146	荣盛发展	7.26	3.42	74.47	1.61
002011	盾安环境	12.32	4.50	89.03	1.48

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	11.45	11.38	48.99	2.04
002450	康得新	32.99	10.33	35.31	1.74
002415	海康威视	30.82	11.10	29.84	1.66
002304	洋河股份	66.80	16.56	21.55	1.51
002594	比亚迪	58.81	16.43	48.95	1.32
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	27.02	40.58	256.61	4.89
002466	天齐锂业	167.80	40.55	237.11	4.87
002736	国信证券	16.42	21.63	38.84	3.20
002304	洋河股份	66.80	16.56	21.55	3.15
002456	欧菲光	26.54	34.04	97.88	3.11
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
002431	棕榈园林	31.80	87.39	690.03	2.07
002488	金固股份	25.22	76.24	279.51	2.01
002496	辉丰股份	29.25	71.55	377.05	1.43
002174	游族网络	117.38	55.86	205.15	1.80
002280	联络互动	25.30	53.19	250.87	3.07
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
002049	同方国芯	43.64	-27.45	101.32	-3.31
002383	合众思壮	33.67	-16.56	115.74	-0.54
002233	塔牌集团	9.30	-1.27	77.91	-0.02
002252	上海莱士	38.17	-0.78	21.69	-0.10
002237	恒邦股份	9.87	0.82	256.24	0.03

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	5.94
300059	东方财富	44.30	33.51	214.05	5.19
300024	机器人	56.55	28.49	109.69	2.85
300017	网宿科技	58.41	12.52	52.00	2.81
300070	碧水源	38.99	15.70	37.92	2.39
贡献前 5 名样本股					
代码	简称	收盘	涨跌幅%	换手率%	贡献点数
300059	东方财富	44.30	33.51	214.05	29.17
300024	机器人	56.55	28.49	109.69	14.14
300033	同花顺	77.00	48.13	271.65	11.07
300027	华谊兄弟	27.96	23.33	104.99	9.44
300408	三环集团	34.27	25.67	22.94	8.38
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
300228	富瑞特装	27.91	62.17	246.67	4.83
300052	中青宝	26.45	60.50	435.58	3.71
300033	同花顺	77.00	48.13	271.65	11.07
300133	华策影视	26.60	47.78	121.40	8.30
300352	北信源	38.33	43.72	280.28	3.77
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
300238	冠昊生物	43.00	-24.12	16.12	-5.69
300088	长信科技	11.00	-12.91	164.22	-3.06
300336	新文化	37.80	-10.00	0.22	-1.70
300347	泰格医药	27.44	-4.06	15.21	-0.73
300431	暴风科技	93.44	-2.49	155.13	-0.39

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	31.81	9.65	15.09	4.05
600016	民生银行	9.11	7.81	11.29	3.17
601166	兴业银行	15.53	9.52	16.24	2.44
000002	万科 A	24.43	0.00	0.00	2.23
600000	浦发银行	17.93	-2.82	10.79	2.07
贡献前 5 名样本股					
代码	简称	收盘	涨跌幅%	换手率%	贡献点数
601318	中国平安	31.81	9.65	15.09	11.50
600030	中信证券	17.80	24.65	69.27	10.51
600016	民生银行	9.11	7.81	11.29	7.40
601166	兴业银行	15.53	9.52	16.24	6.82
600519	贵州茅台	247.64	15.23	19.70	6.24
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
600570	恒生电子	58.34	67.60	248.51	4.41
300133	华策影视	26.60	47.78	121.40	1.42
000750	国海证券	11.68	42.27	135.93	1.85
600633	浙报传媒	17.10	41.21	150.65	1.15
002673	西部证券	27.02	40.58	256.61	3.27
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
600383	金地集团	11.62	-18.63	41.91	-2.26
000876	新希望	16.08	-15.32	86.20	-1.15
601699	潞安环能	7.29	-8.53	91.01	-0.30
000738	中航动控	29.25	-6.94	168.83	-0.39
000983	西山煤电	7.53	-5.76	172.55	-0.28

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%
002466	天齐锂业	167.80	40.55	237.11	0.75
600654	中安消	28.84	0.00	0.00	0.63
600122	宏图高科	19.42	0.00	0.00	0.51
600201	生物股份	30.94	23.91	30.74	0.51
600079	人福医药	18.60	22.53	51.10	0.48
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	167.80	40.55	237.11	13.39
002431	棕榈园林	31.80	87.39	690.03	8.70
002174	游族网络	117.38	55.86	205.15	8.10
601880	大连港	6.69	82.28	95.58	7.12
600074	保千里	16.10	37.02	151.27	6.96
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
002431	棕榈园林	31.80	87.39	690.03	8.70
601880	大连港	6.69	82.28	95.58	7.12
002174	游族网络	117.38	55.86	205.15	8.10
600537	亿晶光电	14.30	49.11	143.54	2.49
000697	炼石有色	26.03	46.98	100.28	6.54
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
000066	长城电脑	14.10	-34.54	106.49	-8.67
000748	长城信息	23.55	-32.48	112.07	-13.02
002049	同方国芯	43.64	-27.45	101.32	-7.04
600200	江苏吴中	22.39	-19.72	48.00	-5.21
300088	长信科技	11.00	-12.91	164.22	-2.36

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	31.81	9.65	15.09	1.77
600016	民生银行	9.11	7.81	11.29	1.26
601166	兴业银行	15.53	9.52	16.24	1.05
600036	招商银行	16.09	10.51	11.41	0.86
600030	中信证券	17.80	24.65	69.27	0.80
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	17.80	24.65	69.27	5.55
601318	中国平安	31.81	9.65	15.09	5.48
600016	民生银行	9.11	7.81	11.29	3.21
601166	兴业银行	15.53	9.52	16.24	3.20
600519	贵州茅台	247.64	15.23	19.70	2.96
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
300023	宝德股份	35.17	103.68	813.46	0.33
300264	佳创视讯	26.51	101.60	284.15	0.43
002768	国恩股份	40.03	88.07	463.55	0.23
002431	棕榈园林	31.80	87.39	690.03	0.63
601880	大连港	6.69	82.28	95.58	0.62
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
000066	长城电脑	14.10	-34.54	106.49	-0.92
000748	长城信息	23.55	-32.48	112.07	-1.50
002049	同方国芯	43.64	-27.45	101.32	-1.01
002664	信质电机	23.84	-24.96	159.67	-0.26
300238	冠昊生物	43.00	-24.12	16.12	-0.47

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:

$$\text{静态PE} = \frac{\sum(\text{最新价格}_{\text{个股}} \times \text{最新总股本}_{\text{个股}})}{\sum(\text{最近年报归属母公司利润}_{\text{个股}})}$$

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:

$$\text{一年滚动PE} = \frac{\sum(\text{最新价格}_{\text{个股}} \times \text{最新总股本}_{\text{个股}})}{\sum(\text{最新滚动归属母公司利润}_{\text{个股}})}$$

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:

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

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。