

广发基金指数月报

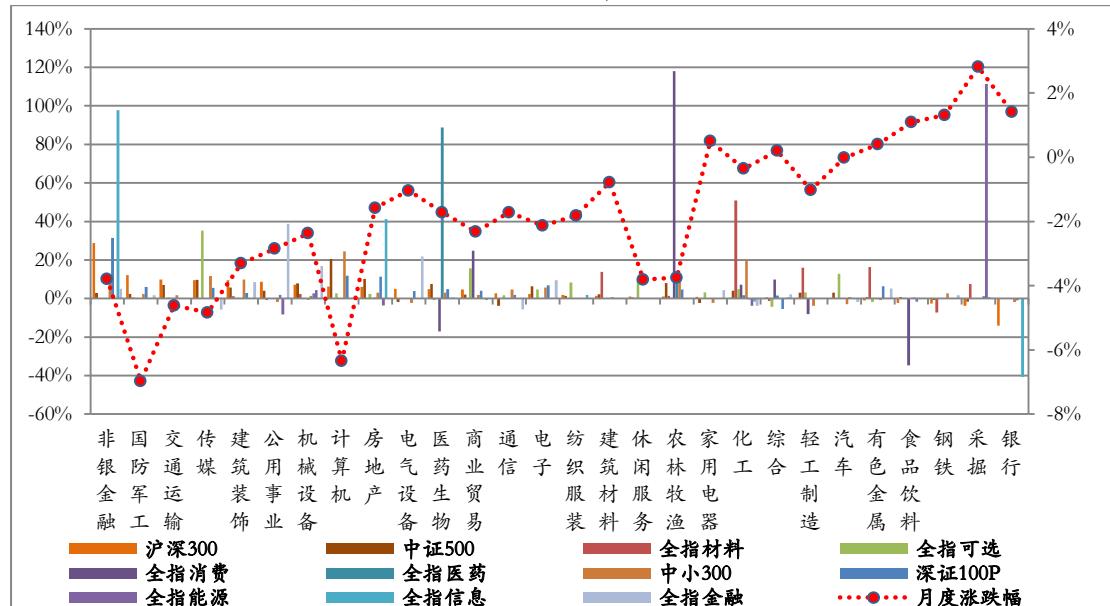
(2016年4月1日—2016年4月29日)
广发基金数量投资部

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

本月两市窄幅盘整，申万 28 个一级行业跌多涨少，仅采掘、银行、钢铁和食品饮料等 7 个行业略有上涨，国防军工和计算机行业跌幅在 6% 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 28.8%；计算机行业对中证 500 指数贡献最大，贡献率为 20.5%；计算机行业对中小 300 指数贡献居首，贡献率为 24.5%；非银金融行业对深证 100 指数贡献最大，贡献率为 31.4%。

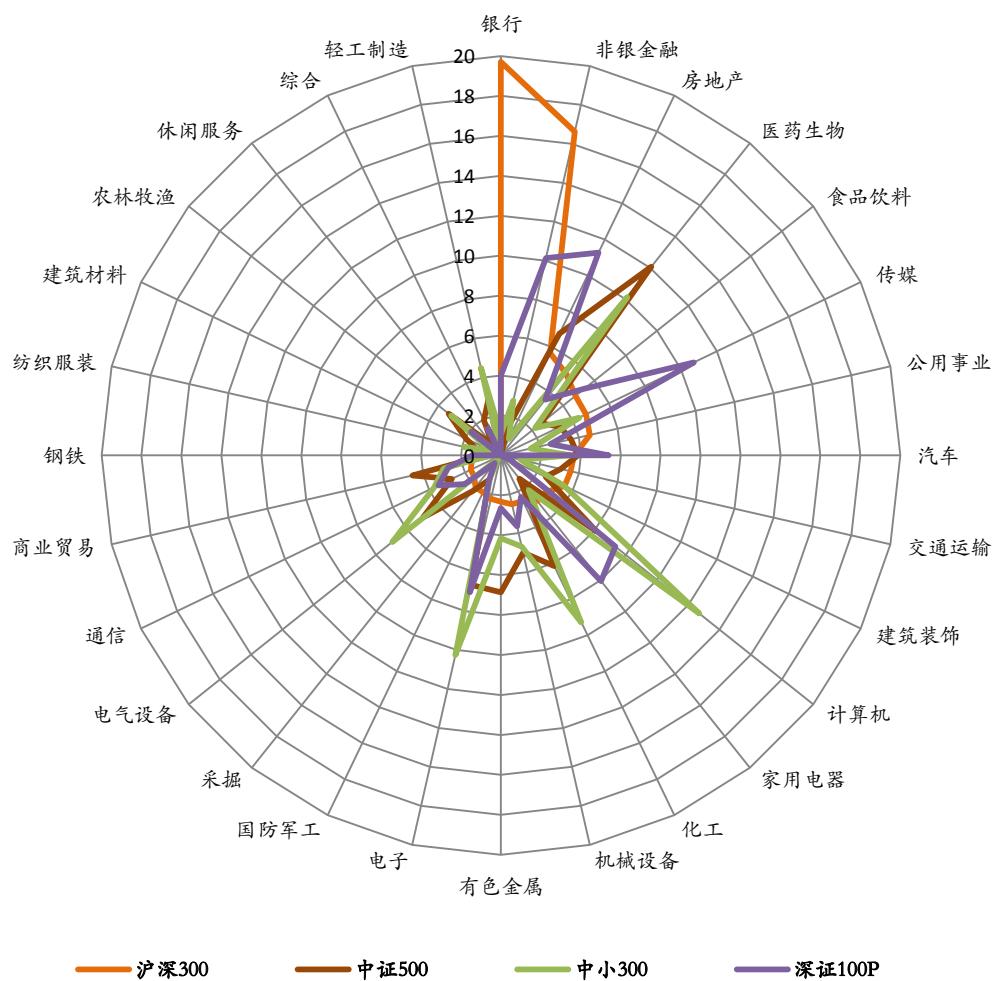
图 1 成份行业贡献率与月度涨跌幅

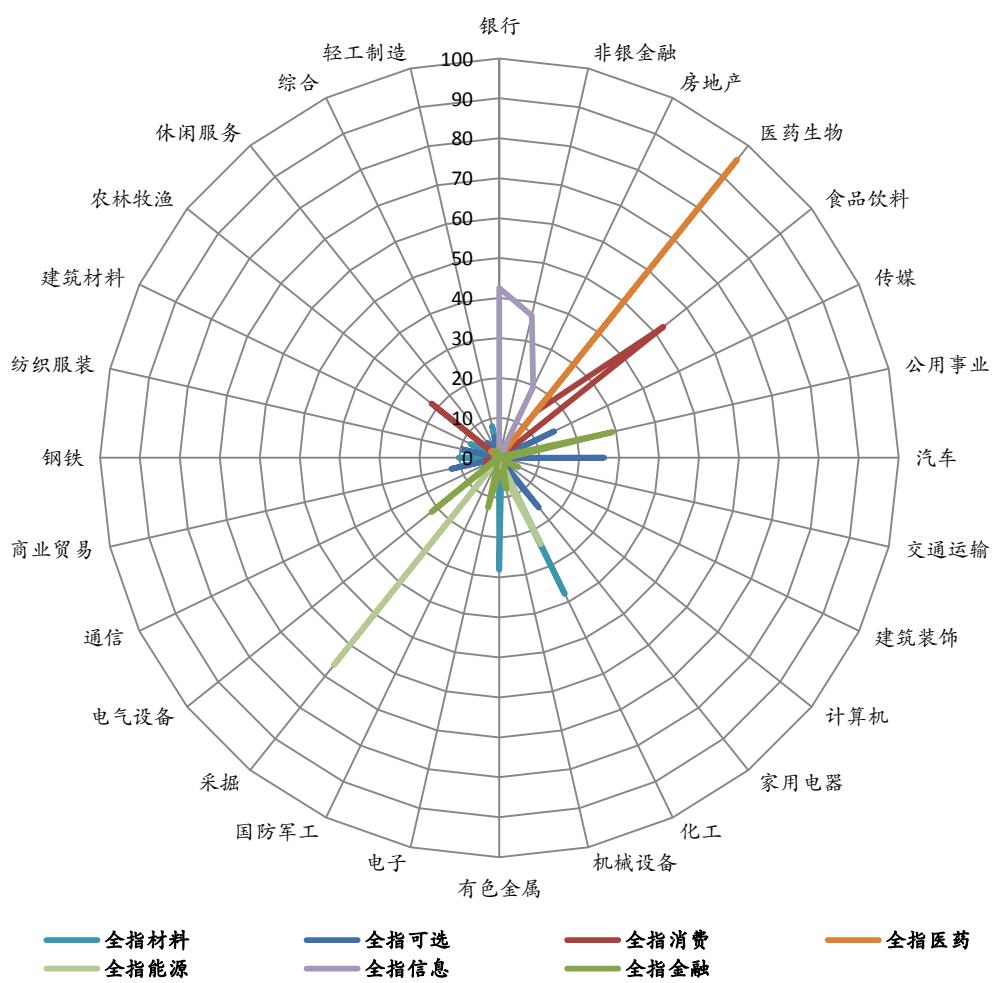


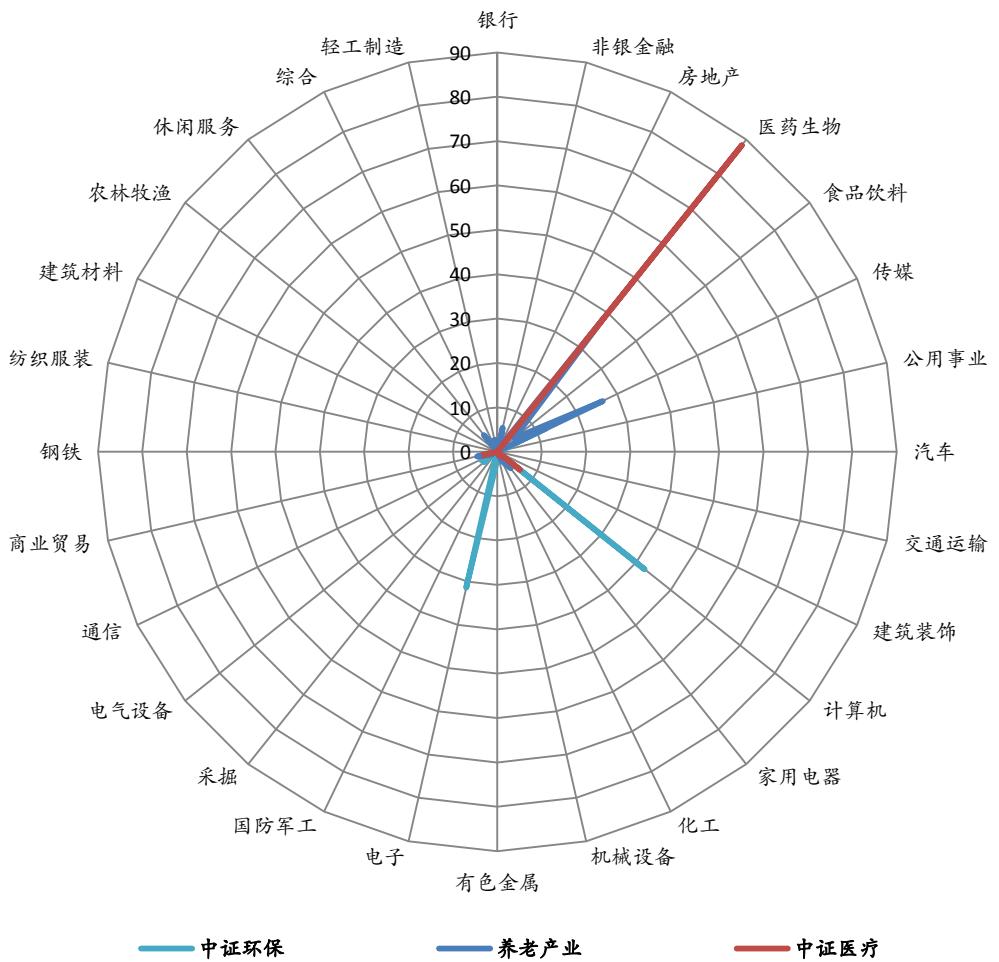
以巨潮数据库提供的权重数据计算，本月末银行业在沪深 300 指数中所占比重居首，为 19.7%。医药生物、有色金属和房地产行业在中证 500 指数中权重居前，依次为 12.1%、6.86% 和 6.76%。计算机、电子和医药生物行业在中小 300 指数中权重居前，分别为 12.71%、10.25% 和 10.14%。房地产、传媒和非银金融

行业在深证 100 指数中权重位列前三，依次为 11.27%、10.72% 和 10.13%。

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 0.704%。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 1.67%，跟踪效果较好。

表 1 基金净值与跟踪误差

基金简称	2016 年 4 月		2016 年 3 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	1.3938	1.6838	1.4169	1.7069	1.6658	2008/12/30
广发中证 500ETF 联接	1.2484	1.2484	1.2878	1.2878	0.3340	2009/11/26

广发中小板 300ETF	1.3971	1.2693	1.4233	1.2931	0.7037	2011/6/3
广发中小板 300 联接	1.1608	1.1608	1.1810	1.1810	0.7674	2011/6/9
广发深证 100 分级	0.9443	1.0635	0.9681	1.0873	2.4604	2012/5/7
广发中证 500ETF	1.6364	1.6364	1.6874	1.6874	0.5541	2013/4/11
广发全指可选消费 ETF	1.4691	1.4691	1.4935	1.4935	0.2062	2014/6/3
广发全指医药卫生 ETF	1.1764	1.1764	1.2070	1.2070	0.3069	2014/12/1
广发全指信息技术 ETF	1.1049	1.1049	1.1537	1.1537	0.4156	2015/1/8
广发中证养老产业	0.9156	0.9156	0.9349	0.9349	1.1138	2015/2/13
广发全指金融地产 ETF	0.7377	0.7377	0.7460	0.7460	0.2512	2015/3/23
广发中证环保产业	0.7076	0.7076	0.7230	0.7230	0.9638	2015/3/25
广发全指原材料 ETF	0.7672	0.7672	0.7676	0.7676	0.6032	2015/6/25
广发全指能源 ETF	0.6447	0.6447	0.6241	0.6241	0.1522	2015/6/25
广发全指主要消费 ETF	0.8707	0.8707	0.8737	0.8737	0.4932	2015/7/1
广发中证医疗分级	1.0987	0.7222	1.1216	0.7370	0.8693	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

4 月沪深两市小幅下跌，覆盖两市的申万 A 指跌幅 14.75%。指数方面，本期核心市场指数中，上证 50 跌幅最小，下跌 0.98%；创业板指表现最差，跌幅为 4.45%。

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	2156.54	2156.78	2197.74	2093.82	2135.51	-0.98%	5339.85
上证 180	6921.88	6915.13	7090.74	6696.42	6799.63	-1.77%	14216.67
深证成指	10455.37	10410.68	10810.41	9976.05	10141.54	-3.00%	31517.90
深证 100P	3681.69	3672.16	3785.87	3535.27	3589.91	-2.49%	9536.96
中小板指	6864.80	6837.75	7060.89	6501.63	6616.83	-3.61%	6723.56
中小板 300	1466.29	1458.84	1519.39	1400.19	1431.76	-2.35%	17755.70

创业板指	2238.29	2223.38	2330.06	2083.64	2138.74	-4.45%	7539.73
沪深 300	3218.09	3213.67	3296.52	3107.37	3156.75	-1.91%	22576.41
中证 500	6155.81	6129.72	6421.73	5888.06	5985.59	-2.77%	22188.57
申万 A 指	3481.39	3469.24	3607.14	3363.62	3417.27	-1.84%	113790.89

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	1872.67	1868.49	2031.23	1864.34	1935.82	3.37%	2048.93
全指材料	3047.67	3037.78	3242.18	2976.31	3033.43	-0.47%	17032.95
全指工业	3922.85	3907.75	4071.45	3728.77	3778.70	-3.67%	20052.47
全指可选	5656.34	5634.95	5877.40	5450.28	5560.54	-1.69%	14796.67
全指消费	7887.16	7865.54	8080.97	7547.01	7856.42	-0.39%	4591.10
全指医药	9190.63	9161.61	9554.07	8802.44	8956.77	-2.54%	5134.42
全指金融	5247.75	5240.95	5357.94	5098.86	5188.62	-1.13%	9393.88
全指信息	6362.14	6326.07	6590.60	5972.27	6089.70	-4.28%	17633.26
全指电信	5673.60	5646.10	5901.55	5472.16	5562.13	-1.96%	2449.21
全指公用	2540.39	2535.45	2593.81	2430.45	2449.67	-3.57%	1736.78
中证全指	4650.48	4634.78	4816.35	4493.23	4564.67	-1.85%	109360.41

图3 核心指数月度表现

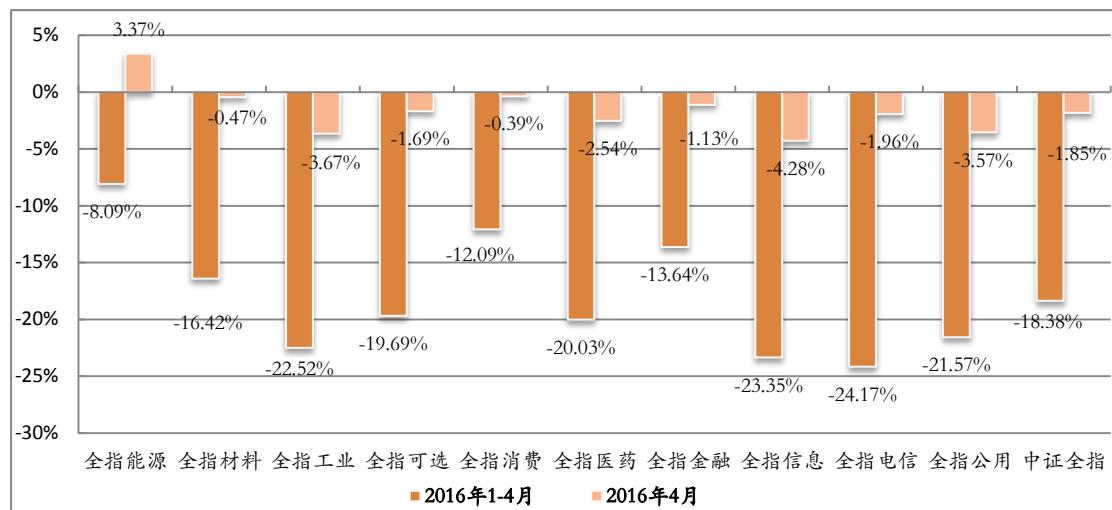


图4 核心指数本月绝对收益

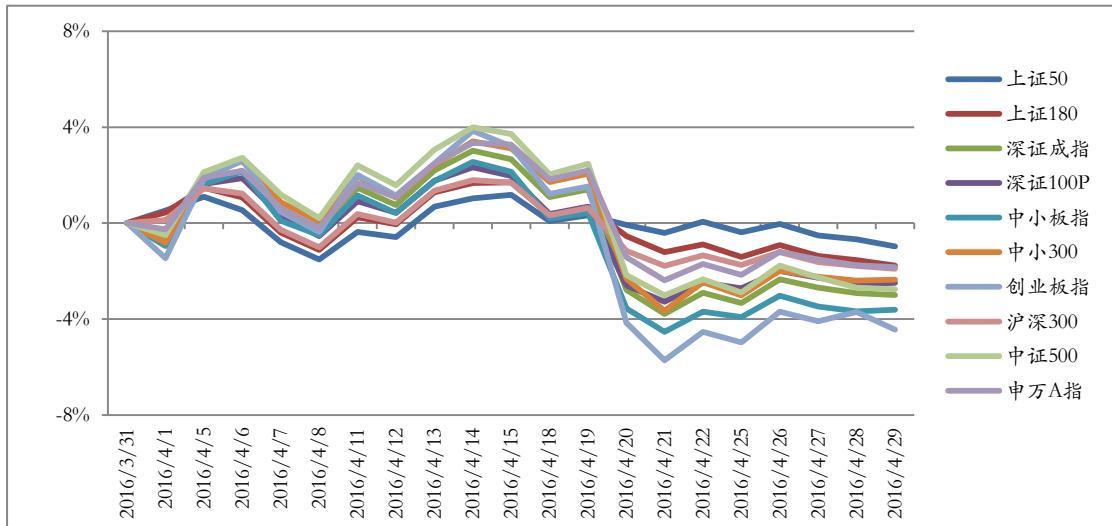
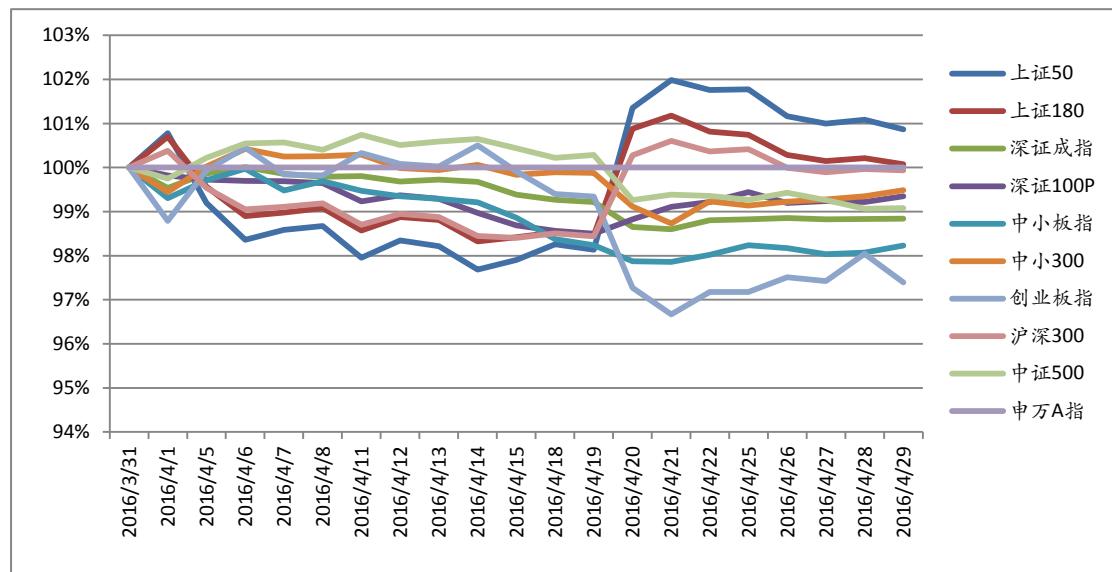


图5 核心指数本月超额收益对比



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

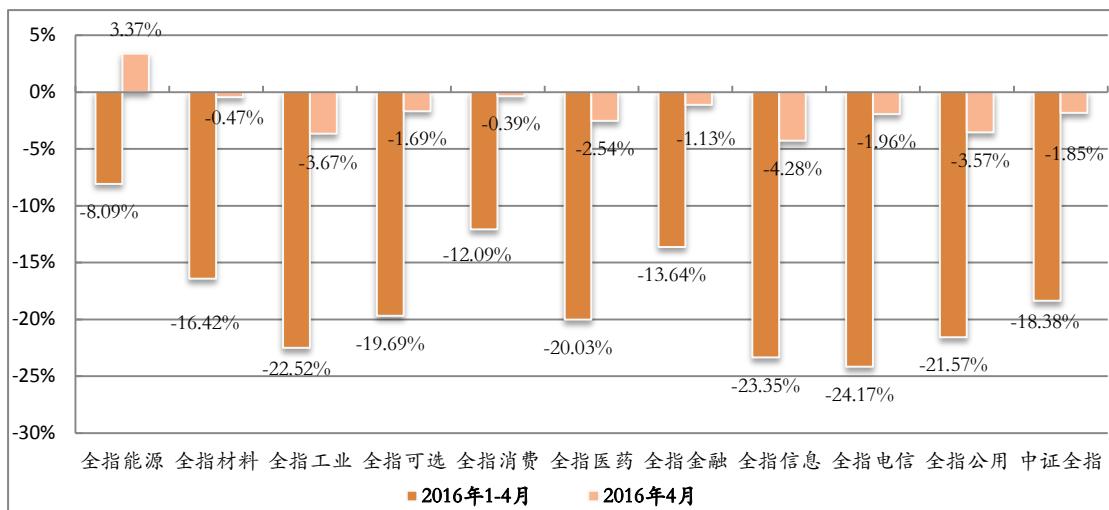


图 7 行业指数本月绝对收益

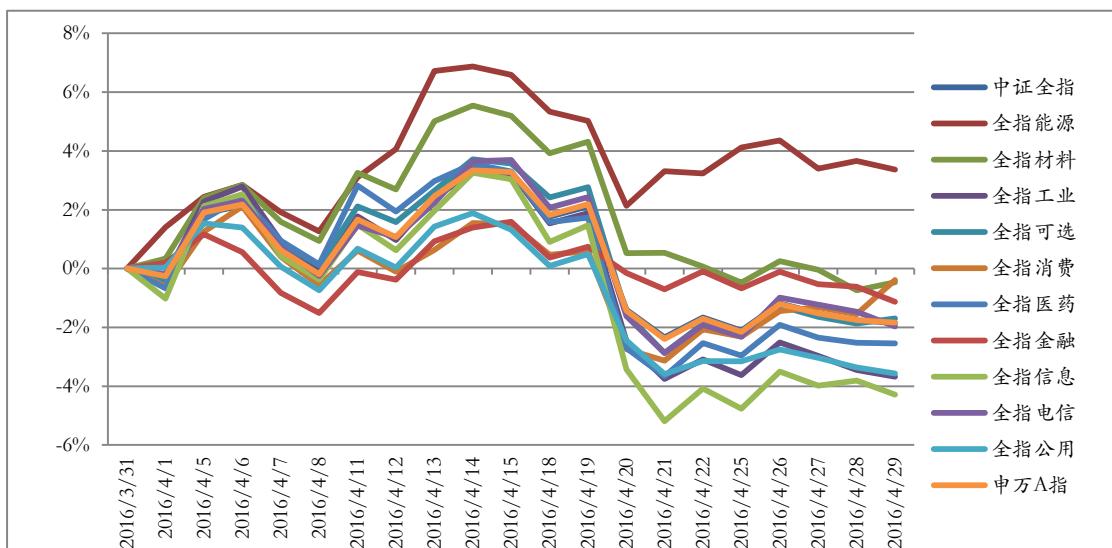
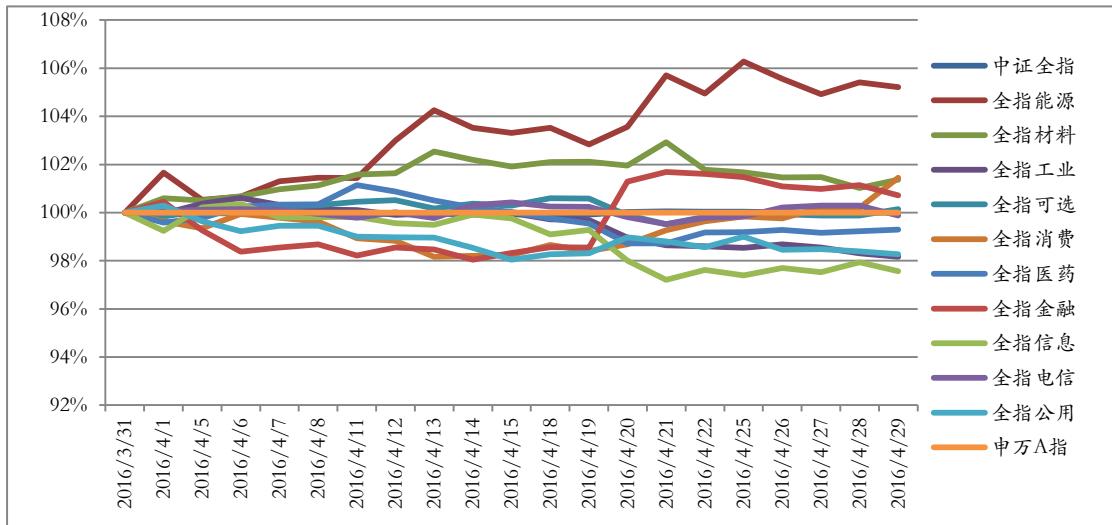


图 8 行业指数本月超额收益对比



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4月份核心指数的估值水平小幅回落，市场平均动态（2016年）市盈率为15.09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9.09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	9.12	9.16	9.09	1.01
上证180	10.06	9.99	9.70	1.11
深证成指	28.28	27.56	22.33	2.77
深证100	19.71	19.40	17.41	2.27
中小板指	31.91	32.16	26.50	3.90
中小300	38.82	38.15	28.54	3.91
创业板指	56.04	49.84	34.60	6.20
沪深300	11.41	11.32	10.96	1.25
中证500	36.57	34.45	25.58	2.60
申万A指	17.55	17.15	15.09	1.79

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	28.92	32.81	31.68	0.99
全指材料	49.85	46.38	31.64	2.15
全指工业	27.56	26.16	20.71	2.08
全指可选	25.65	24.65	19.51	2.73
全指消费	28.58	27.18	22.50	3.34
全指医药	41.87	40.36	31.50	4.32
全指金融	7.87	7.83	7.67	1.05
全指信息	58.98	56.75	36.74	4.67
全指电信	43.05	43.23	28.47	1.75
全指公用	15.95	15.67	13.88	1.56
中证全指	17.30	16.92	14.95	1.76

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	32.04	0.69	9.19	9.56
600016	民生银行	9.30	2.09	7.04	7.57
601166	兴业银行	16.12	3.80	10.56	5.92
600036	招商银行	17.75	10.32	8.38	5.04
600000	浦发银行	17.83	-0.56	8.57	4.83
贡献前 5 名样本股					
代码	简称	收盘	涨跌幅%	换手率%	贡献点数
600036	招商银行	17.75	10.32	8.38	10.07
601166	兴业银行	16.12	3.80	10.56	4.63
600837	海通证券	15.03	5.11	24.82	3.48
600016	民生银行	9.30	2.09	7.04	3.30
601601	中国太保	27.61	5.26	14.61	2.55
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
600036	招商银行	17.75	10.32	8.38	10.07
600111	北方稀土	13.43	5.84	94.35	0.95
601601	中国太保	27.61	5.26	14.61	2.55
600837	海通证券	15.03	5.11	24.82	3.48
601088	中国神华	14.78	5.05	24.31	0.83
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
601989	中国重工	6.30	-12.38	25.25	-4.80
600018	上港集团	4.91	-11.53	24.48	-1.22
600958	东方证券	18.07	-11.03	40.04	-1.39
600637	东方明珠	25.65	-10.54	16.90	-3.26
600150	中国船舶	22.71	-9.59	48.87	-0.97

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	32.04	0.69	9.19	5.99
600016	民生银行	9.30	2.09	7.04	4.74
601166	兴业银行	16.12	3.80	10.56	3.71
600036	招商银行	17.75	10.32	8.38	3.16
600000	浦发银行	17.83	-0.56	8.57	3.02
贡献前 5 名样本股					
代码	简称	收盘	涨跌幅%	换手率%	贡献点数
600036	招商银行	17.75	10.32	8.38	20.11
601166	兴业银行	16.12	3.80	10.56	9.25
600837	海通证券	15.03	5.11	24.82	6.96
600016	民生银行	9.30	2.09	7.04	6.59
601601	中国太保	27.61	5.26	14.61	5.10
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
600094	大名城	9.26	23.36	113.39	2.29
600547	山东黄金	30.49	16.13	116.97	3.56
600005	武钢股份	3.31	13.75	80.70	1.92
600157	永泰能源	4.41	12.79	58.99	1.98
600185	格力地产	19.39	12.73	119.61	0.79
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
600490	鹏欣资源	7.23	-16.40	109.53	-1.72
601018	宁波港	5.95	-14.03	44.40	-4.40
601718	际华集团	8.11	-13.62	80.22	-2.33
600516	方大炭素	8.91	-12.82	104.11	-1.58
601106	中国一重	5.41	-12.74	39.24	-2.42

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	2.73
000651	格力电器	19.22	0.00	0.00	1.73
000001	平安银行	10.57	-0.66	14.70	1.32
000333	美的集团	32.10	4.05	13.61	1.30
300104	乐视网	58.80	0.00	0.00	1.12
贡献前 5 名样本股					
代码	简称	收盘	涨跌幅%	换手率%	贡献点数
002168	深圳惠程	14.85	67.04	98.89	8.48
000503	海虹控股	29.08	21.93	73.58	7.21
000839	中信国安	20.60	15.86	228.30	5.96
002407	多氟多	91.57	18.31	401.52	5.33
002241	歌尔声学	28.67	11.99	45.69	5.15
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
002168	深圳惠程	14.85	67.04	98.89	8.48
002522	浙江众成	16.35	29.86	163.72	2.79
300157	恒泰艾普	12.13	25.83	119.37	2.40
000503	海虹控股	29.08	21.93	73.58	7.21
300134	大富科技	22.49	20.85	273.60	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
002018	华信国际	12.56	-45.82	125.12	-20.12
300336	新文化	27.80	-26.45	181.17	-3.45
002280	联络互动	19.71	-22.09	130.72	-6.22
002440	闰土股份	15.36	-21.75	67.80	-3.59
002019	亿帆鑫富	42.13	-21.66	138.60	-3.95

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	6.10
000651	格力电器	19.22	0.00	0.00	3.86
000001	平安银行	10.57	-0.66	14.70	2.94
000333	美的集团	32.10	4.05	13.61	2.90
300104	乐视网	58.80	0.00	0.00	2.51
贡献前 5 名样本股					
代码	简称	收盘	涨跌幅%	换手率%	贡献点数
000503	海虹控股	29.08	21.93	73.58	5.70
000839	中信国安	20.60	15.86	228.30	4.72
002241	歌尔声学	28.67	11.99	45.69	4.08
300017	网宿科技	63.81	9.59	35.12	4.07
002594	比亚迪	63.71	8.33	40.57	4.07
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
000503	海虹控股	29.08	21.93	73.58	5.70
000839	中信国安	20.60	15.86	228.30	4.72
002241	歌尔声学	28.67	11.99	45.69	4.08
300251	光线传媒	25.47	10.50	39.99	1.75
000917	电广传媒	17.99	10.03	12.43	2.92
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
000831	*ST 五稀	14.44	-17.63	127.75	-3.09
002292	奥飞娱乐	33.77	-17.05	160.98	-4.68
000712	锦龙股份	18.99	-13.45	66.00	-2.22
002673	西部证券	23.61	-12.62	107.95	-5.40
002385	大北农	10.43	-11.61	29.51	-2.86

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	11.10	-2.53	45.81	3.88
002450	康得新	33.97	2.97	30.95	3.50
002415	海康威视	30.47	-1.14	19.54	3.21
002304	洋河股份	67.61	1.21	16.07	3.00
002594	比亚迪	63.71	8.33	40.57	2.80
贡献前 5 名样本股					
代码	简称	收盘	涨跌幅%	换手率%	贡献点数
002168	深圳惠程	14.85	67.04	98.89	23.48
002241	歌尔声学	28.67	11.99	45.69	14.27
002594	比亚迪	63.71	8.33	40.57	14.24
002038	双鹭药业	28.30	19.06	60.93	10.21
002450	康得新	33.97	2.97	30.95	6.68
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
002168	深圳惠程	14.85	67.04	98.89	23.48
002038	双鹭药业	28.30	19.06	60.93	10.21
002396	星网锐捷	19.98	17.53	232.51	5.02
002106	莱宝高科	10.36	16.93	91.11	4.28
002241	歌尔声学	28.67	11.99	45.69	14.27
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
002018	华信国际	12.56	-45.82	125.12	-55.72
002280	联络互动	19.71	-22.09	130.72	-17.22
002428	云南锗业	15.39	-19.84	114.88	-9.22
002657	中科金财	51.35	-19.10	162.33	-10.21
002292	奥飞娱乐	33.77	-17.05	160.98	-16.40

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	11.10	-2.53	45.81	2.03
002450	康得新	33.97	2.97	30.95	1.83
002415	海康威视	30.47	-1.14	19.54	1.68
002304	洋河股份	67.61	1.21	16.07	1.57
002594	比亚迪	63.71	8.33	40.57	1.46
贡献前 5 名样本股					
代码	简称	收盘	涨跌幅%	换手率%	贡献点数
002168	深圳惠程	14.85	67.04	98.89	2.66
002407	多氟多	91.57	18.31	401.52	1.67
002460	赣锋锂业	62.23	21.45	364.44	1.64
002241	歌尔声学	28.67	11.99	45.69	1.61
002594	比亚迪	63.71	8.33	40.57	1.61
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
002168	深圳惠程	14.85	67.04	98.89	2.66
002522	浙江众成	16.35	29.86	163.72	0.87
002460	赣锋锂业	62.23	21.45	364.44	1.64
002245	澳洋顺昌	10.04	19.81	89.95	0.61
002038	双鹭药业	28.30	19.06	60.93	1.16
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
002018	华信国际	12.56	-45.82	125.12	-6.30
002280	联络互动	19.71	-22.09	130.72	-1.95
002440	闰土股份	15.36	-21.75	67.80	-1.12
002019	亿帆鑫富	42.13	-21.66	138.60	-1.24
002428	云南锗业	15.39	-19.84	114.88	-1.04

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	6.11
300059	东方财富	21.82	-11.16	103.74	4.73
300017	网宿科技	63.81	9.59	35.12	3.15
300024	机器人	26.30	2.50	105.64	2.99
300070	碧水源	40.45	3.74	29.19	2.55
贡献前 5 名样本股					
代码	简称	收盘	涨跌幅%	换手率%	贡献点数
300017	网宿科技	63.81	9.59	35.12	5.91
300072	三聚环保	26.00	19.30	77.93	5.32
300251	光线传媒	25.47	10.50	39.99	2.54
300134	大富科技	22.49	20.85	273.60	2.11
300070	碧水源	40.45	3.74	29.19	1.97
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
300134	大富科技	22.49	20.85	273.60	2.11
300072	三聚环保	26.00	19.30	77.93	5.32
300251	光线传媒	25.47	10.50	39.99	2.54
300017	网宿科技	63.81	9.59	35.12	5.91
300115	长盈精密	31.61	8.44	44.38	1.48
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
300336	新文化	27.80	-26.45	181.17	-3.96
300431	暴风科技	71.38	-23.61	391.24	-3.55
300078	思创医惠	27.41	-18.06	103.37	-3.15
300257	开山股份	14.72	-17.30	63.56	-2.45
300122	智飞生物	26.88	-16.93	47.83	-2.42

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	32.04	0.69	9.19	4.15
600016	民生银行	9.30	2.09	7.04	3.29
601166	兴业银行	16.12	3.80	10.56	2.57
000002	万科 A	24.43	0.00	0.00	2.27
600036	招商银行	17.75	10.32	8.38	2.19
贡献前 5 名样本股					
代码	简称	收盘	涨跌幅%	换手率%	贡献点数
600036	招商银行	17.75	10.32	8.38	6.47
601166	兴业银行	16.12	3.80	10.56	2.98
600837	海通证券	15.03	5.11	24.82	2.24
600016	民生银行	9.30	2.09	7.04	2.12
601601	中国太保	27.61	5.26	14.61	1.64
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
600549	厦门钨业	23.62	23.83	141.48	0.73
000503	海虹控股	29.08	21.93	73.58	1.40
000937	冀中能源	6.30	19.55	134.11	0.42
002038	双鹭药业	28.30	19.06	60.93	0.73
600547	山东黄金	30.49	16.13	116.97	1.11
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
000831	*ST 五稀	14.44	-17.63	127.75	-0.81
002292	奥飞娱乐	33.77	-17.05	160.98	-1.33
002375	亚厦股份	11.41	-15.73	59.50	-0.53
300146	汤臣倍健	13.83	-15.15	58.79	-0.52
600317	营口港	3.57	-14.80	23.53	-0.45

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	158.37	-5.62	209.34	0.73
600122	宏图高科	19.42	0.00	0.00	0.52
600654	中安消	22.70	-21.26	88.76	0.51
000718	苏宁环球	13.19	0.00	0.00	0.47
600584	长电科技	22.02	0.00	0.00	0.47
贡献前 5 名样本股					
代码	简称	收盘	涨跌幅%	换手率%	贡献点数
002168	深圳惠程	14.85	67.04	98.89	8.11
300072	三聚环保	26.00	19.30	77.93	4.30
600522	中天科技	21.47	15.49	36.98	3.70
600094	大名城	9.26	23.36	113.39	3.37
600259	广晟有色	56.59	33.75	191.78	3.28
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
002168	深圳惠程	14.85	67.04	98.89	8.11
600259	广晟有色	56.59	33.75	191.78	3.28
600392	盛和资源	13.69	30.53	285.63	2.66
600094	大名城	9.26	23.36	113.39	3.37
300134	大富科技	22.49	20.85	273.60	1.83
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
002440	闰土股份	15.36	-21.75	67.80	-3.46
600654	中安消	22.70	-21.26	88.76	-8.31
002428	云南锗业	15.39	-19.84	114.88	-3.13
002657	中科金财	51.35	-19.10	162.33	-3.61
000563	陕国投 A	5.81	-18.57	127.66	-2.87

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	32.04	0.69	8.87	1.81
600016	民生银行	9.30	2.09	6.74	1.31
601166	兴业银行	16.12	3.80	9.92	1.10
600036	招商银行	17.75	10.32	7.95	0.96
000002	万科 A	24.43	0.00	0.00	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
600036	招商银行	17.75	10.32	7.95	3.03
601166	兴业银行	16.12	3.80	9.92	1.45
600837	海通证券	15.03	5.11	23.75	0.83
600547	山东黄金	30.49	16.13	113.38	0.74
600016	民生银行	9.30	2.09	6.74	0.72
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
300484	蓝海华腾	172.05	227.03	337.38	0.28
300506	名家汇	43.65	119.13	611.32	0.14
002427	尤夫股份	24.30	67.13	209.40	0.17
002168	深圳惠程	14.85	67.04	87.20	0.70
000980	金马股份	10.07	62.71	156.85	0.32
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
002018	华信国际	12.56	-45.82	109.83	-1.95
000034	神州数码	19.76	-29.30	86.02	-0.42
300028	金亚科技	20.00	-28.44	500.94	-0.40
300336	新文化	27.80	-26.45	175.29	-0.49
002546	新联电子	11.30	-26.05	207.79	-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。