

广发基金指数月报

(2016年5月2日—2016年5月31日)

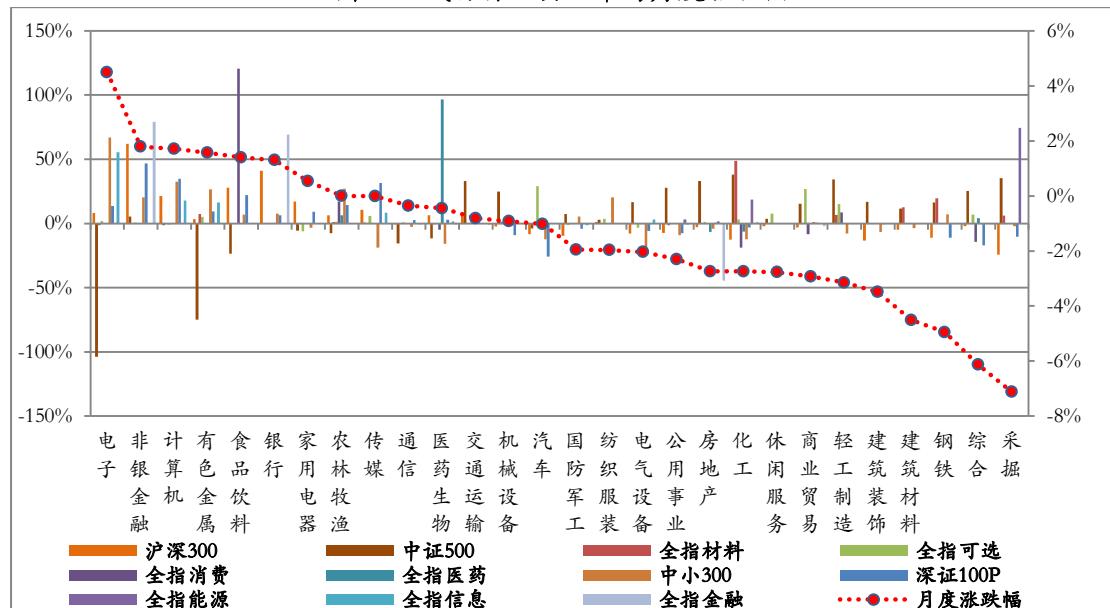
广发基金数量投资部

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

本月两市缩量盘整，申万28个一级行业跌多涨少，仅电子、非银金融、计算机和有色金属等7个行业小幅上涨，采掘和综合行业跌幅在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61.9%；化工行业对中证500指数贡献最大，贡献率为38.1%；电子行业对中小300指数贡献居首，贡献率为66.9%；非银金融行业对深证100指数贡献最大，贡献率为46.6%。

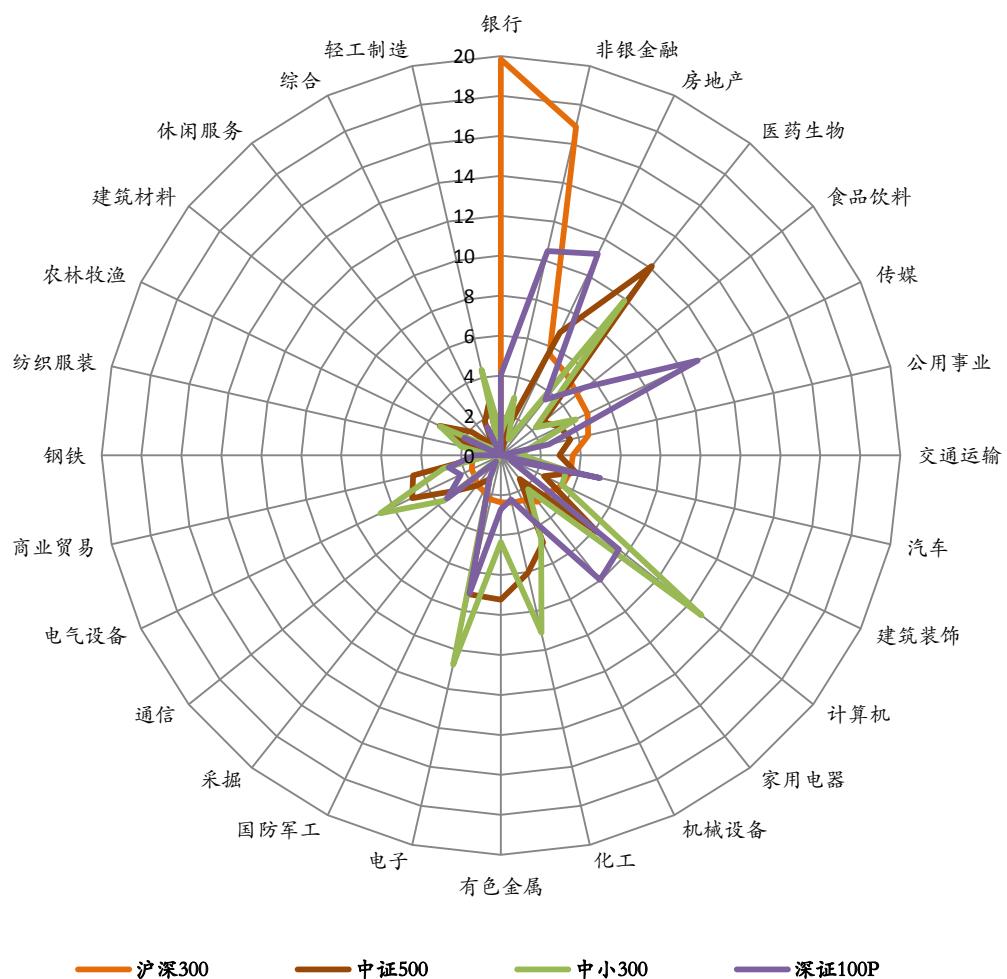
图1 成份行业贡献率与月度涨跌幅

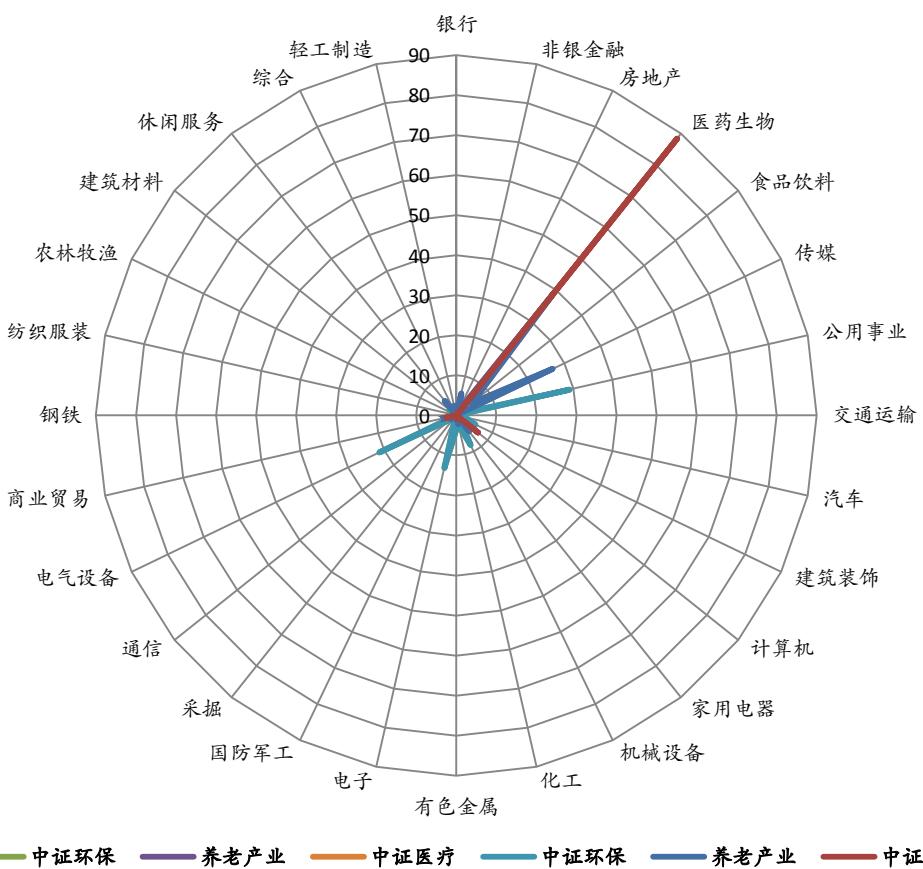
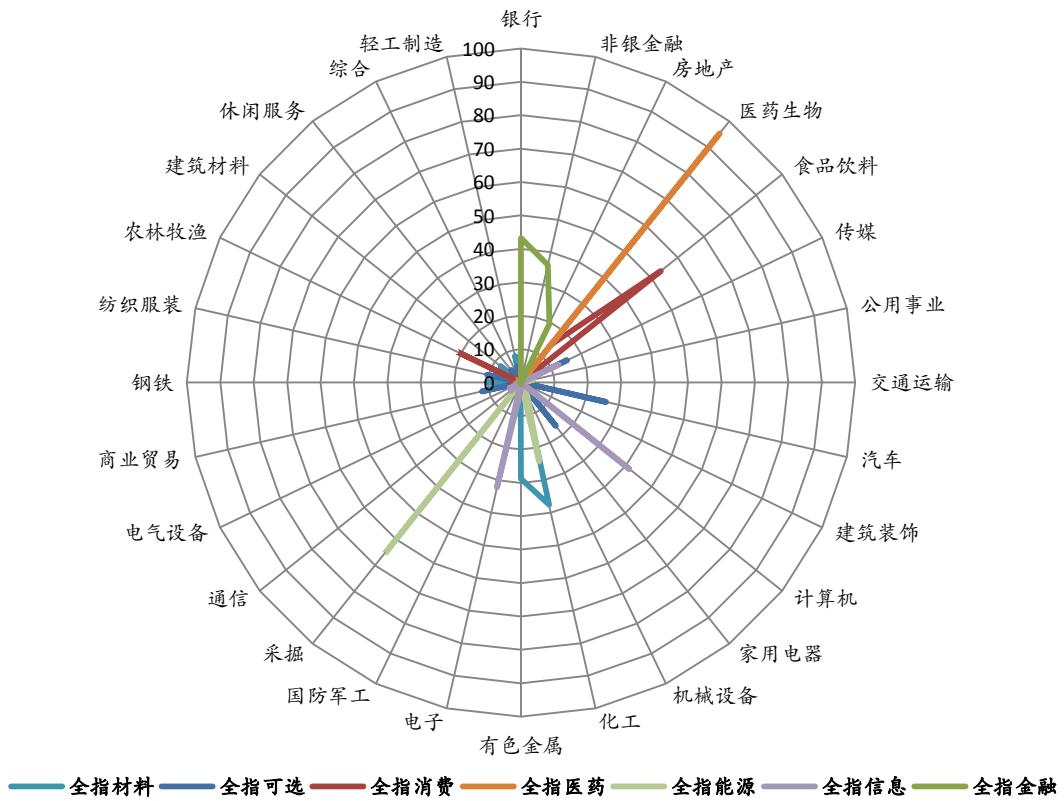


以巨潮数据库提供的权重数据计算，本月末银行业在沪深300指数中所占比重居首，为19.8%。医药生物、有色金属和电子行业在中证500指数中权重居前，依次为12.1%、7.22%和7.13%。计算机、电子和医药生物行业在中小300指数中权重居前，分别为12.85%、10.74%和9.91%。房地产、传媒和非银金融行业

在深证 100 指数中权重位列前三，依次为 11.19%、10.93% 和 10.49%。

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 0.714%。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 1.277%，跟踪效果较好。

表 1 基金净值与跟踪误差

基金简称	2016 年 5 月		2016 年 4 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	1.4023	1.6923	1.3938	1.6838	0.4984	2008/12/30
广发中证 500ETF 联接	1.2436	1.2436	1.2484	1.2484	0.5212	2009/11/26
广发中小板 300ETF	1.4083	1.2795	1.3971	1.2693	0.7136	2011/6/3
广发中小板 300 联接	1.1697	1.1697	1.1608	1.1608	0.7258	2011/6/9
广发深证 100 分级	0.9508	1.0700	0.9443	1.0635	2.9666	2012/5/7
广发中证 500ETF	1.6275	1.6275	1.6364	1.6364	0.2972	2013/4/11
广发全指可选消费 ETF	1.4497	1.4497	1.4691	1.4691	0.5810	2014/6/3
广发全指医药卫生 ETF	1.1751	1.1751	1.1764	1.1764	0.2663	2014/12/1
广发全指信息技术 ETF	1.1396	1.1396	1.1049	1.1049	0.3652	2015/1/8
广发中证养老产业	0.9208	0.9208	0.9156	0.9156	0.7690	2015/2/13
广发全指金融地产 ETF	0.7446	0.7446	0.7377	0.7377	0.4438	2015/3/23
广发中证环保产业	0.7040	0.7040	0.7076	0.7076	1.2770	2015/3/25
广发全指原材料 ETF	0.7537	0.7537	0.7672	0.7672	0.5009	2015/6/25
广发全指能源 ETF	0.6034	0.6034	0.6447	0.6447	0.1412	2015/6/25
广发全指主要消费 ETF	0.8845	0.8845	0.8707	0.8707	1.0384	2015/7/1
广发中证医疗分级	1.1016	0.7240	1.0987	0.7222	1.3038	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

5月沪深两市小幅下跌，覆盖两市的申万A指跌幅为0.64%。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	2135.51	2136.20	2167.73	2053.72	2155.66	0.94%	3688.20
上证180	6799.63	6808.35	6924.04	6522.06	6823.75	0.35%	10496.05
深证成指	10141.54	10144.15	10501.44	9544.12	10159.93	0.18%	25431.03
深证100P	3589.91	3591.53	3689.99	3428.43	3616.60	0.74%	7313.90
中小板指	6616.83	6621.95	6854.62	6250.38	6653.51	0.55%	5627.74
中小板300	1431.76	1433.20	1495.12	1341.17	1440.99	0.65%	16093.65
创业板指	2138.74	2138.96	2235.96	1975.07	2159.80	0.98%	5346.83
沪深300	3156.75	3159.82	3222.88	3027.44	3169.56	0.41%	17194.64
中证500	5985.59	5991.83	6226.88	5559.69	5947.32	-0.64%	18005.29
申万A指	3417.27	3419.04	3528.24	3193.74	3395.38	-0.64%	90133.06

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	1935.82	1933.02	1958.31	1741.39	1812.62	-6.36%	1160.44
全指材料	3033.43	3039.16	3138.59	2760.37	2973.99	-1.96%	14213.30
全指工业	3778.70	3781.63	3919.35	3497.39	3700.16	-2.08%	14074.84
全指可选	5560.54	5563.76	5753.70	5168.83	5475.16	-1.54%	10923.07
全指消费	7856.42	7864.73	8219.97	7592.39	7958.35	1.30%	4632.53
全指医药	8956.77	8934.54	9284.59	8524.97	8941.02	-0.18%	3698.05
全指金融	5188.62	5190.55	5270.79	4973.14	5235.67	0.91%	6674.42
全指信息	6089.70	6096.24	6384.58	5614.00	6276.06	3.06%	15280.76
全指电信	5562.13	5570.23	5789.88	5151.28	5558.10	-0.07%	1843.27
全指公用	2449.67	2451.66	2498.35	2309.97	2405.15	-1.82%	1344.51
中证全指	4564.67	4566.71	4709.04	4271.86	4532.85	-0.70%	85129.19

图3 核心指数月度表现

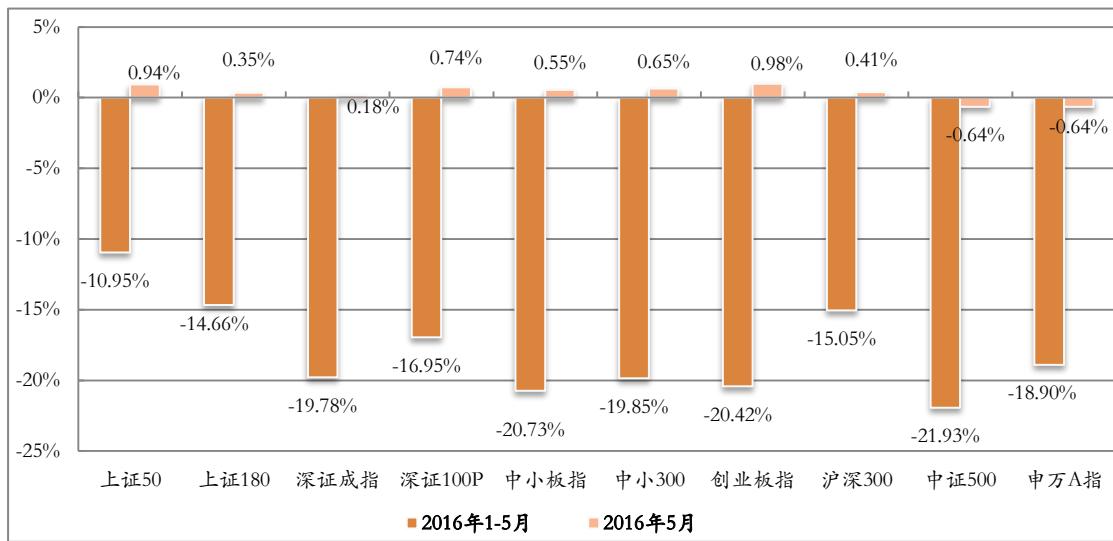


图4 核心指数本月绝对收益

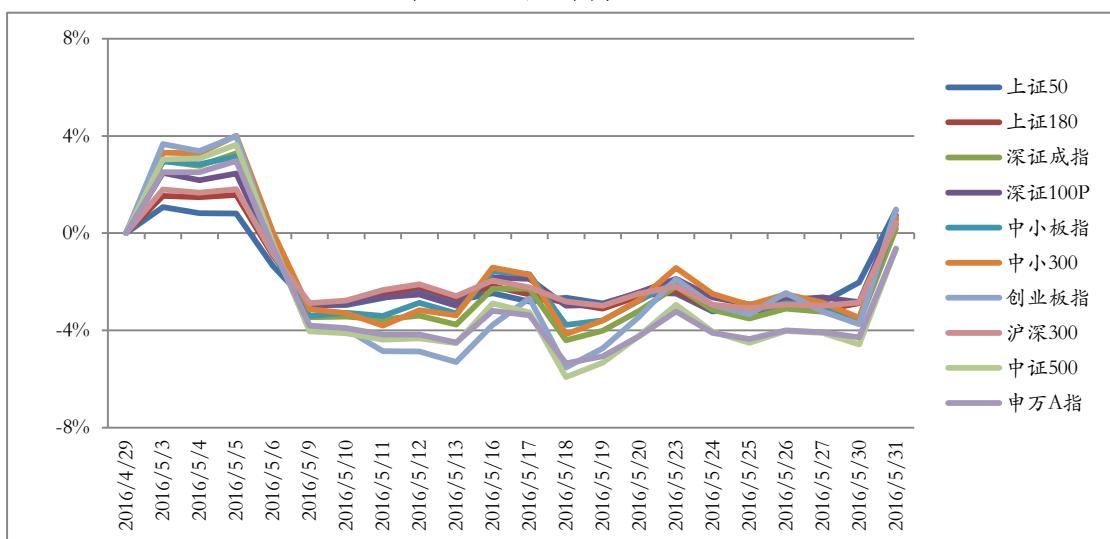
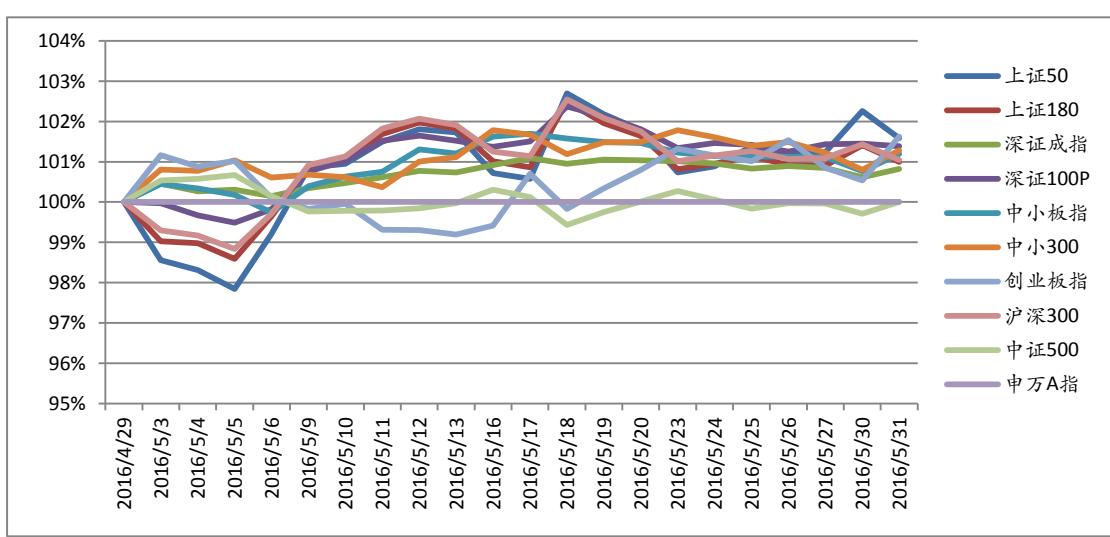


图5 核心指数本月超额收益对比



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

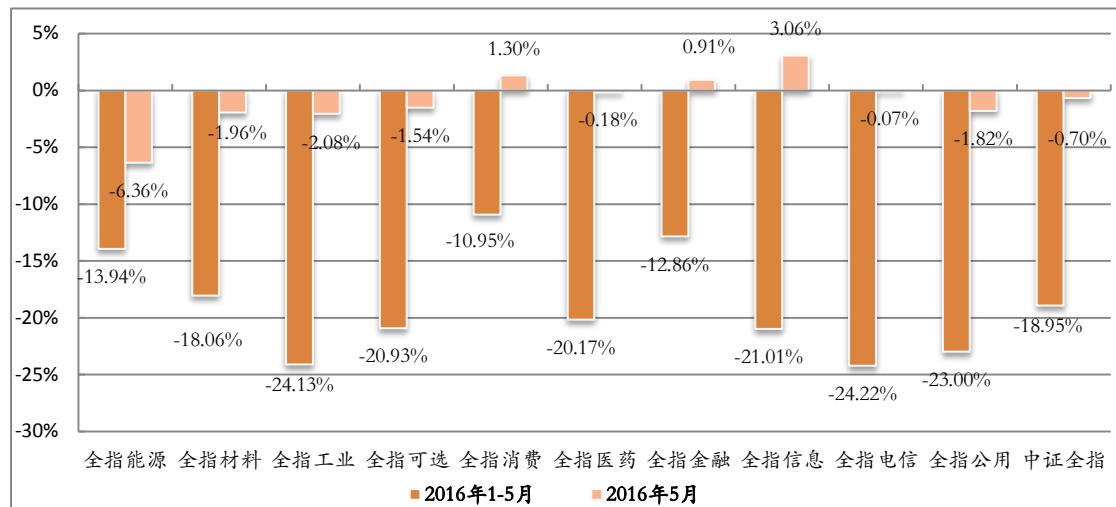


图 7 行业指数本月绝对收益

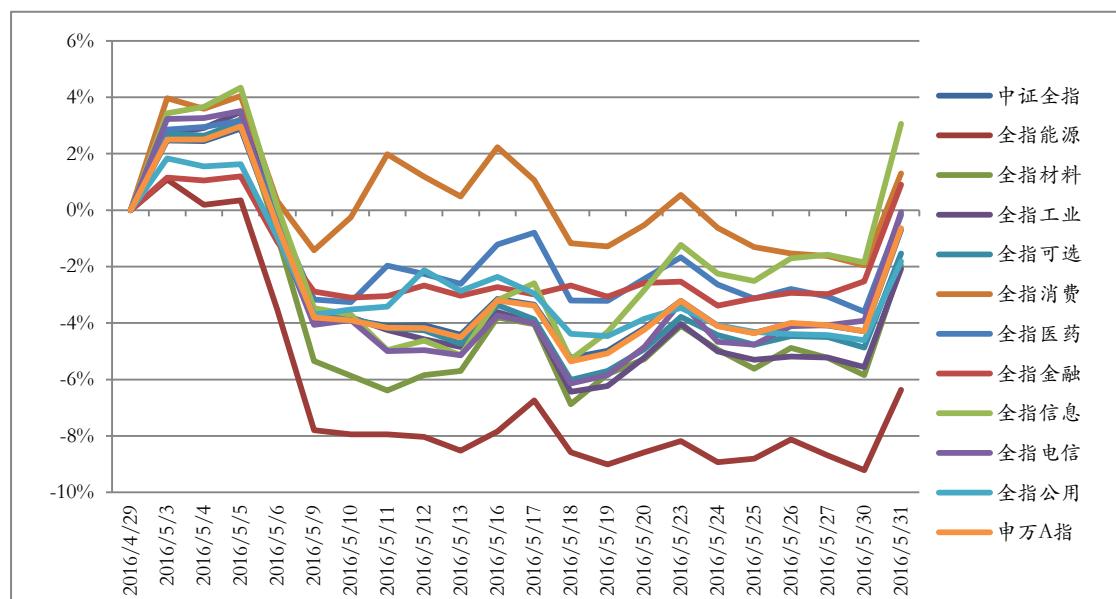
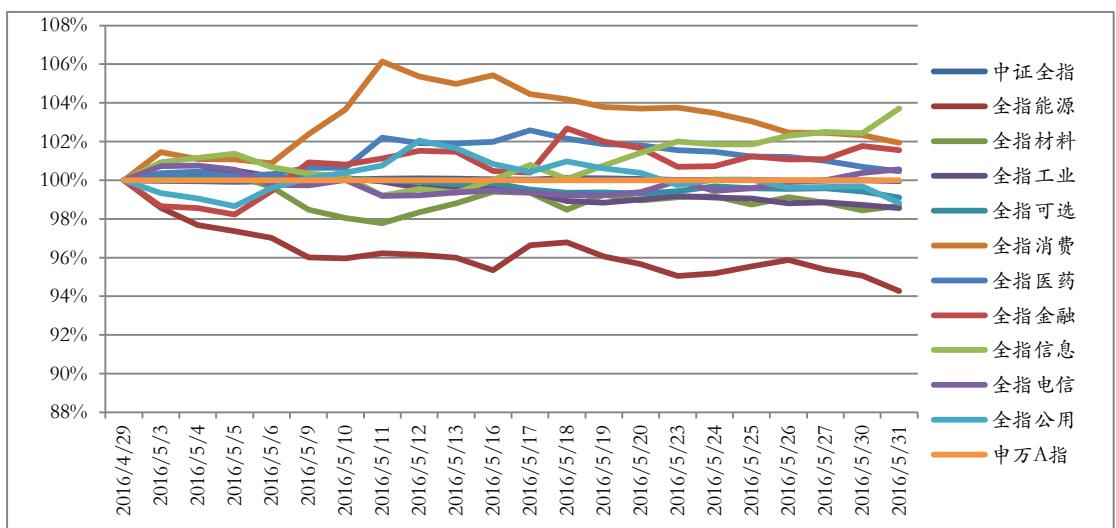


图 8 行业指数本月超额收益对比



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5月份核心指数的估值水平小幅上升，市场平均动态（2016年）市盈率为15.23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9.20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	31.48	9.24	9.20	1.00
上证180	34.61	10.03	9.77	1.09
深证成指	119.16	27.72	22.72	2.74
深证100	85.34	19.37	17.61	2.24
中小板指	141.92	32.24	26.74	3.83
中小300	159.81	38.11	28.86	3.85
创业板指	212.02	50.76	35.41	6.19
沪深300	40.32	11.35	11.03	1.24
中证500	135.01	34.39	26.03	2.56
申万A指	61.92	17.14	15.23	1.76

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	32.72	2.12	7.20	9.67
600016	民生银行	9.09	-2.26	7.11	7.33
601166	兴业银行	16.20	0.50	7.14	5.89
600036	招商银行	18.00	1.41	5.47	5.07
600000	浦发银行	18.29	2.58	5.58	4.90
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	32.72	2.12	7.20	4.34
600519	贵州茅台	264.47	5.28	12.35	3.92
600837	海通证券	15.85	5.46	12.83	3.90
600887	伊利股份	15.41	5.62	16.60	2.96
601169	北京银行	10.76	4.47	6.11	2.74
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
600111	北方稀土	15.04	11.99	95.95	2.05
600018	上港集团	5.24	6.72	13.67	0.63
601688	华泰证券	18.48	6.14	20.64	2.07
601336	新华保险	42.28	5.96	27.77	0.87
600887	伊利股份	15.41	5.62	16.60	2.96
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
600893	中航动力	33.76	-7.30	19.59	-1.22
600585	海螺水泥	15.23	-5.81	17.10	-1.10
601088	中国神华	13.95	-5.62	13.33	-0.96
601669	中国电建	6.01	-4.45	9.96	-0.68
601800	中国交建	11.00	-3.51	17.35	-0.36

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	32.72	2.12	7.20	6.09
600016	民生银行	9.09	-2.26	7.11	4.62
601166	兴业银行	16.20	0.50	7.14	3.71
600036	招商银行	18.00	1.41	5.47	3.19
600000	浦发银行	18.29	2.58	5.58	3.09
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	32.72	2.12	7.20	8.64
600519	贵州茅台	264.47	5.28	12.35	7.81
600837	海通证券	15.85	5.46	12.83	7.77
600100	同方股份	15.19	24.30	143.26	6.19
600887	伊利股份	15.41	5.62	16.60	5.93
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
600639	浦东金桥	23.08	39.71	297.58	1.92
600839	四川长虹	4.97	35.42	134.95	5.65
600100	同方股份	15.19	24.30	143.26	6.19
603993	洛阳钼业	3.86	14.54	27.15	1.48
600029	南方航空	6.84	12.87	89.11	3.21
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
600873	梅花生物	6.88	-24.73	37.58	-4.92
600005	武钢股份	2.93	-11.48	36.67	-1.82
600325	华发股份	10.94	-10.11	33.23	-1.02
600185	格力地产	6.17	-9.95	93.57	-0.67
600489	中金黄金	9.68	-8.95	41.39	-1.81

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	2.72
000651	格力电器	19.22	0.00	0.00	1.72
000001	平安银行	10.55	-0.19	11.72	1.31
000333	美的集团	21.35	3.55	13.25	1.29
300104	乐视网	58.77	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
000503	海虹控股	39.60	36.18	85.25	14.48
000970	中科三环	16.21	32.87	184.61	6.96
002340	格林美	14.12	28.60	176.50	6.68
002500	山西证券	14.77	21.96	169.00	6.07
002405	四维图新	32.05	20.99	4.62	5.83
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	39.60	36.18	85.25	14.48
002463	沪电股份	6.03	35.20	127.38	3.39
300134	大富科技	29.89	33.97	332.78	3.59
000970	中科三环	16.21	32.87	184.61	6.96
002577	雷柏科技	49.20	32.65	406.84	2.33
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
000807	云铝股份	6.13	-22.60	67.58	-2.97
002312	三泰控股	18.24	-20.35	209.49	-3.99
002018	华信国际	10.01	-20.30	196.95	-4.83
000629	*ST 钣钛	2.39	-19.80	38.59	-4.44
002573	清新环境	18.42	-17.91	14.29	-4.96

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	6.05
000651	格力电器	19.22	0.00	0.00	3.83
000001	平安银行	10.55	-0.19	11.72	2.91
000333	美的集团	21.35	3.55	13.25	2.87
300104	乐视网	58.77	0.00	0.00	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
000503	海虹控股	39.60	36.18	85.25	11.46
000970	中科三环	16.21	32.87	184.61	5.50
002500	山西证券	14.77	21.96	169.00	4.80
002405	四维图新	32.05	20.99	4.62	4.62
000858	五粮液	30.03	5.74	39.07	4.56
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
000503	海虹控股	39.60	36.18	85.25	11.46
000970	中科三环	16.21	32.87	184.61	5.50
002500	山西证券	14.77	21.96	169.00	4.80
002405	四维图新	32.05	20.99	4.62	4.62
002385	大北农	8.29	20.05	43.02	4.35
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
000629	*ST 钣钛	2.39	-19.80	38.59	-3.51
000709	河钢股份	2.79	-12.81	39.45	-2.90
000839	中信国安	18.13	-11.99	164.61	-4.13
300058	蓝色光标	9.73	-10.41	40.00	-2.35
000625	长安汽车	14.50	-9.43	32.73	-4.91

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	11.02	-0.72	23.79	3.83
002450	康得新	32.98	-2.91	31.42	3.38
002415	海康威视	21.11	6.17	18.82	3.32
002304	洋河股份	68.33	1.06	13.51	3.01
002594	比亚迪	59.80	-6.14	27.00	2.61
贡献前 5 名样本股					
代码	简称	收盘	涨跌幅%	换手率%	贡献点数
002340	格林美	14.12	28.60	176.50	18.51
002500	山西证券	14.77	21.96	169.00	16.82
002405	四维图新	32.05	20.99	4.62	16.17
002385	大北农	8.29	20.05	43.02	15.24
002456	欧菲光	29.18	14.21	86.69	14.83
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
002340	格林美	14.12	28.60	176.50	18.51
002050	三花股份	9.17	26.36	73.93	8.47
002500	山西证券	14.77	21.96	169.00	16.82
002405	四维图新	32.05	20.99	4.62	16.17
002385	大北农	8.29	20.05	43.02	15.24
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
002312	三泰控股	18.24	-20.35	209.49	-11.06
002018	华信国际	10.01	-20.30	196.95	-13.38
002573	清新环境	18.42	-17.91	14.29	-13.73
002429	兆驰股份	7.86	-12.47	32.50	-3.95
002168	深圳惠程	13.03	-12.26	119.28	-7.17

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	11.02	-0.72	23.79	2.00
002450	康得新	32.98	-2.91	31.42	1.77
002415	海康威视	21.11	6.17	18.82	1.73
002304	洋河股份	68.33	1.06	13.51	1.57
002594	比亚迪	59.80	-6.14	27.00	1.36
贡献前 5 名样本股					
代码	简称	收盘	涨跌幅%	换手率%	贡献点数
002070	众和股份	27.16	61.09	407.23	3.07
002340	格林美	14.12	28.60	176.50	2.09
002500	山西证券	14.77	21.96	169.00	1.90
002405	四维图新	32.05	20.99	4.62	1.83
002385	大北农	8.29	20.05	43.02	1.72
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
002070	众和股份	27.16	61.09	407.23	3.07
002463	沪电股份	6.03	35.20	127.38	1.06
002577	雷柏科技	49.20	32.65	406.84	0.73
002371	七星电子	30.05	32.20	115.11	0.78
002340	格林美	14.12	28.60	176.50	2.09
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
002312	三泰控股	18.24	-20.35	209.49	-1.25
002018	华信国际	10.01	-20.30	196.95	-1.51
002573	清新环境	18.42	-17.91	14.29	-1.55
002037	久联发展	15.78	-14.19	44.09	-0.40
002544	杰赛科技	26.32	-14.07	33.16	-0.79

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	58.77	0.00	0.00	6.03
300059	东方财富	21.99	0.78	99.99	4.71
300017	网宿科技	67.06	5.09	51.96	3.27
300024	机器人	25.57	-2.78	49.02	2.88
300027	华谊兄弟	14.92	8.51	72.11	2.41
贡献前 5 名样本股					
代码	简称	收盘	涨跌幅%	换手率%	贡献点数
300088	长信科技	14.14	19.53	182.53	4.25
300134	大富科技	29.89	33.97	332.78	4.13
300027	华谊兄弟	14.92	8.51	72.11	4.09
300017	网宿科技	67.06	5.09	51.96	3.43
300408	三环集团	17.65	8.62	16.95	3.29
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	29.89	33.97	332.78	4.13
300011	鼎汉技术	23.86	29.53	98.61	3.06
300004	南风股份	19.23	23.19	113.36	2.19
300088	长信科技	14.14	19.53	182.53	4.25
300433	蓝思科技	84.77	19.29	131.84	2.24
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
300058	蓝色光标	9.73	-10.41	40.00	-3.41
300053	欧比特	14.17	-8.93	47.50	-1.30
300144	宋城演艺	25.09	-8.10	36.16	-2.49
300136	信维通信	17.89	-7.52	39.19	-2.12
300090	盛运环保	8.13	-7.19	45.13	-0.85

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	32.72	2.12	7.20	4.22
600016	民生银行	9.09	-2.26	7.11	3.20
601166	兴业银行	16.20	0.50	7.14	2.57
000002	万科 A	24.43	0.00	0.00	2.26
600036	招商银行	18.00	1.41	5.47	2.21
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	39.60	36.18	85.25	2.83
601318	中国平安	32.72	2.12	7.20	2.78
600519	贵州茅台	264.47	5.28	12.35	2.51
600837	海通证券	15.85	5.46	12.83	2.51
600100	同方股份	15.19	24.30	143.26	1.98
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	39.60	36.18	85.25	2.83
600839	四川长虹	4.97	35.42	134.95	1.82
600100	同方股份	15.19	24.30	143.26	1.98
002500	山西证券	14.77	21.96	169.00	1.15
002385	大北农	8.29	20.05	43.02	1.27
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
600873	梅花生物	6.88	-24.73	37.58	-1.61
000629	*ST 钢钛	2.39	-19.80	38.59	-0.95
000937	冀中能源	5.32	-15.56	72.72	-0.41
601699	潞安环能	6.41	-14.53	60.30	-0.47
000983	西山煤电	7.39	-13.67	83.12	-0.68

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	44.50	6.95	272.91	0.78
002405	四维图新	32.05	20.99	4.62	0.54
600122	宏图高科	19.38	0.00	0.00	0.52
600522	中天科技	22.71	5.78	70.15	0.49
600201	生物股份	27.63	1.28	18.95	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
000970	中科三环	16.21	32.87	184.61	5.99
002340	格林美	14.12	28.60	176.50	5.63
002405	四维图新	32.05	20.99	4.62	5.56
600392	盛和资源	19.29	40.91	358.57	4.71
600366	宁波韵升	25.71	31.68	300.96	4.08
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
600392	盛和资源	19.29	40.91	358.57	4.71
600639	浦东金桥	23.08	39.71	297.58	2.94
002463	沪电股份	6.03	35.20	127.38	3.21
300134	大富科技	29.89	33.97	332.78	3.43
000970	中科三环	16.21	32.87	184.61	5.99
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
600770	综艺股份	12.20	-26.33	143.89	-6.00
600395	盘江股份	8.58	-22.14	108.44	-2.81
600546	*ST 山煤	3.08	-19.79	53.44	-1.30
600654	中安消	18.54	-17.98	45.20	-5.53
002573	清新环境	18.42	-17.91	14.29	-4.54

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	32.72	2.12	7.20	1.85
600016	民生银行	9.09	-2.26	7.11	1.27
601166	兴业银行	16.20	0.50	7.14	1.11
600036	招商银行	18.00	1.41	5.47	0.93
600030	中信证券	16.79	2.13	20.01	0.76
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	39.60	36.18	85.25	1.37
601318	中国平安	32.72	2.12	7.20	1.30
600519	贵州茅台	264.47	5.28	12.35	1.19
600837	海通证券	15.85	5.46	12.83	0.99
002070	众和股份	27.16	61.09	407.23	0.95
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
300509	新美星	60.01	115.40	557.42	0.13
300508	维宏股份	126.85	104.63	527.70	0.15
300340	科恒股份	45.19	85.59	446.35	0.29
600707	彩虹股份	12.57	61.16	459.69	0.50
002070	众和股份	27.16	61.09	407.23	0.95
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
000796	凯撒旅游	16.78	-38.89	91.58	-0.43
600365	通葡股份	12.31	-35.28	150.31	-0.31
601918	*ST 新集	3.89	-34.18	77.79	-0.45
300366	创意信息	34.55	-33.31	164.29	-0.19
002208	合肥城建	17.54	-32.28	287.66	-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:

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

- 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:

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

- 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:

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

- 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。