

广发基金指数月报

(2016年6月1日—2016年6月30日)

广发基金数量投资部

一、广发基金旗下指数基金运作

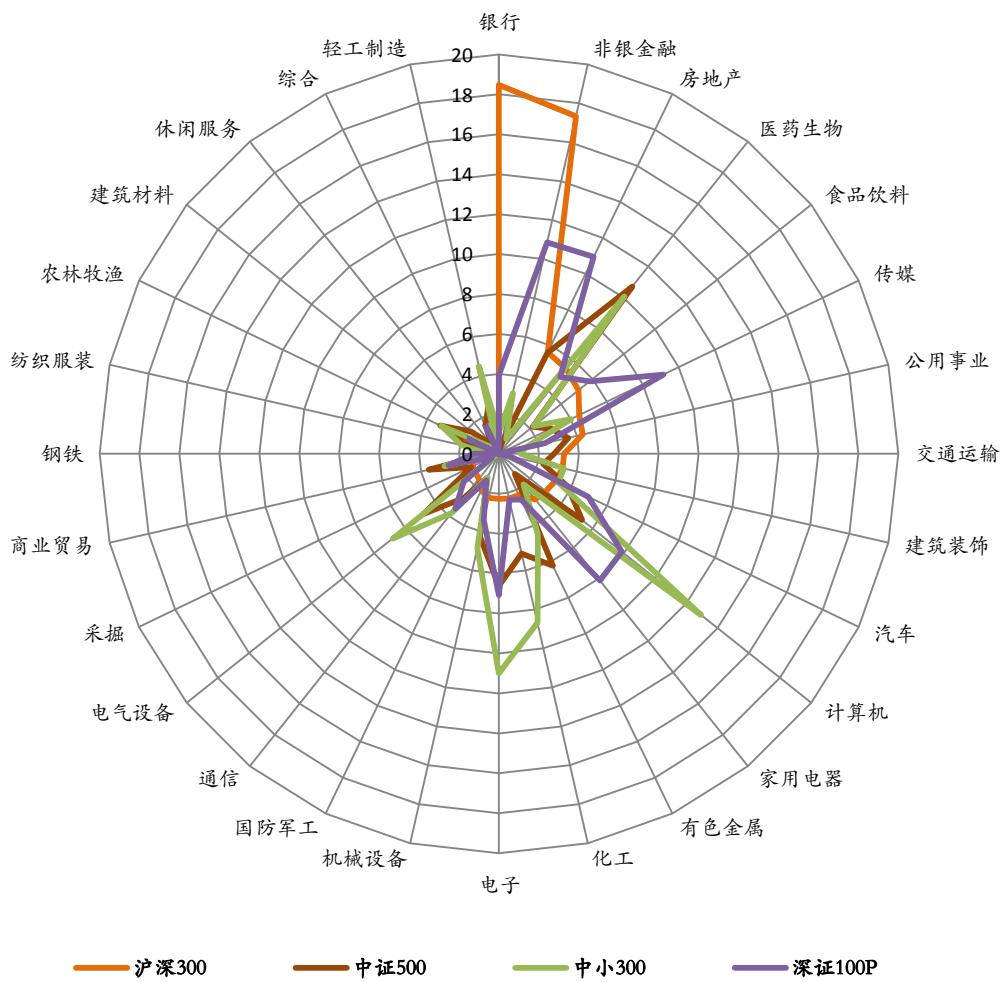
(一) 标的指数行业贡献及分布

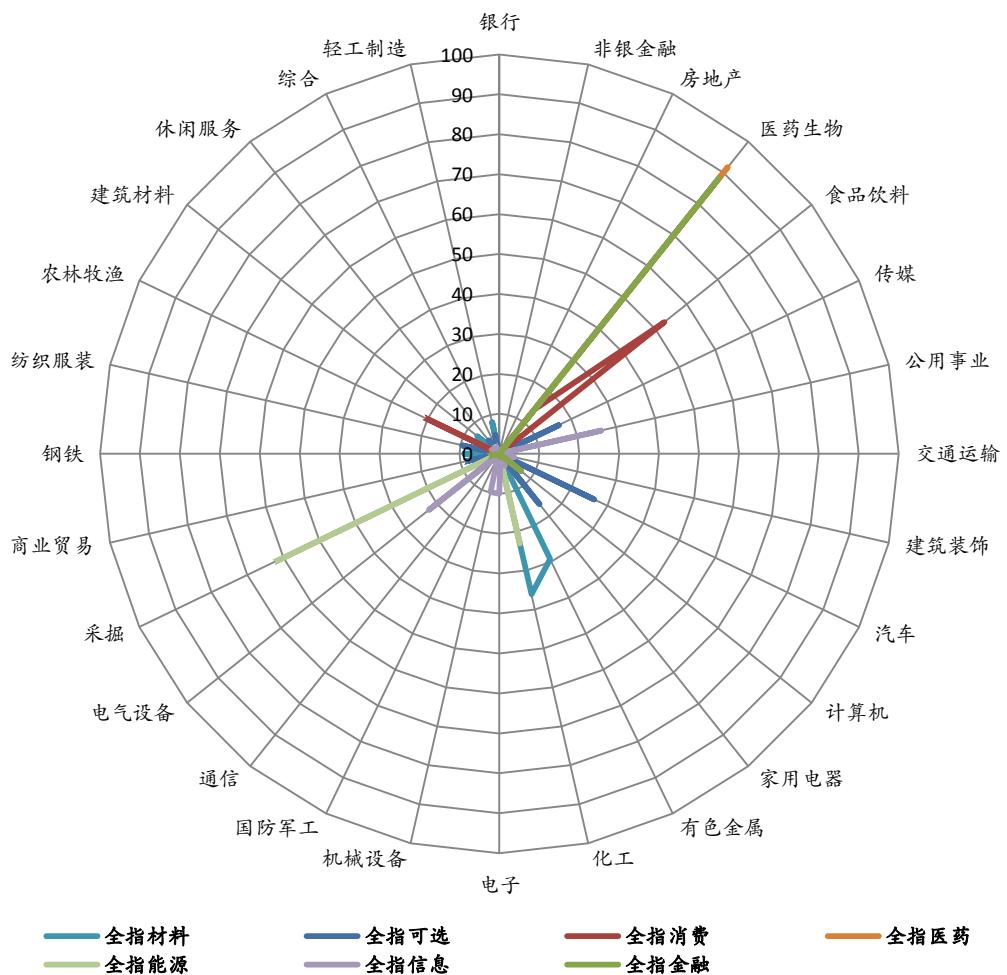
本月两市小幅反弹，申万28个一级行业涨多跌少，仅银行、交通运输、钢铁和传媒等7个行业小幅下跌，电子、国防军工和电气设备的涨幅均在7%以上。从各指数成份股的行业贡献率来看，食品饮料行业对沪深300指数影响最大，贡献率为548.8%；计算机行业对中证500指数贡献最大，贡献率为14.6%；电子行业对中小300指数贡献居首，贡献率为15.5%；非银金融行业对深证100指数贡献最大，贡献率为30.7%。

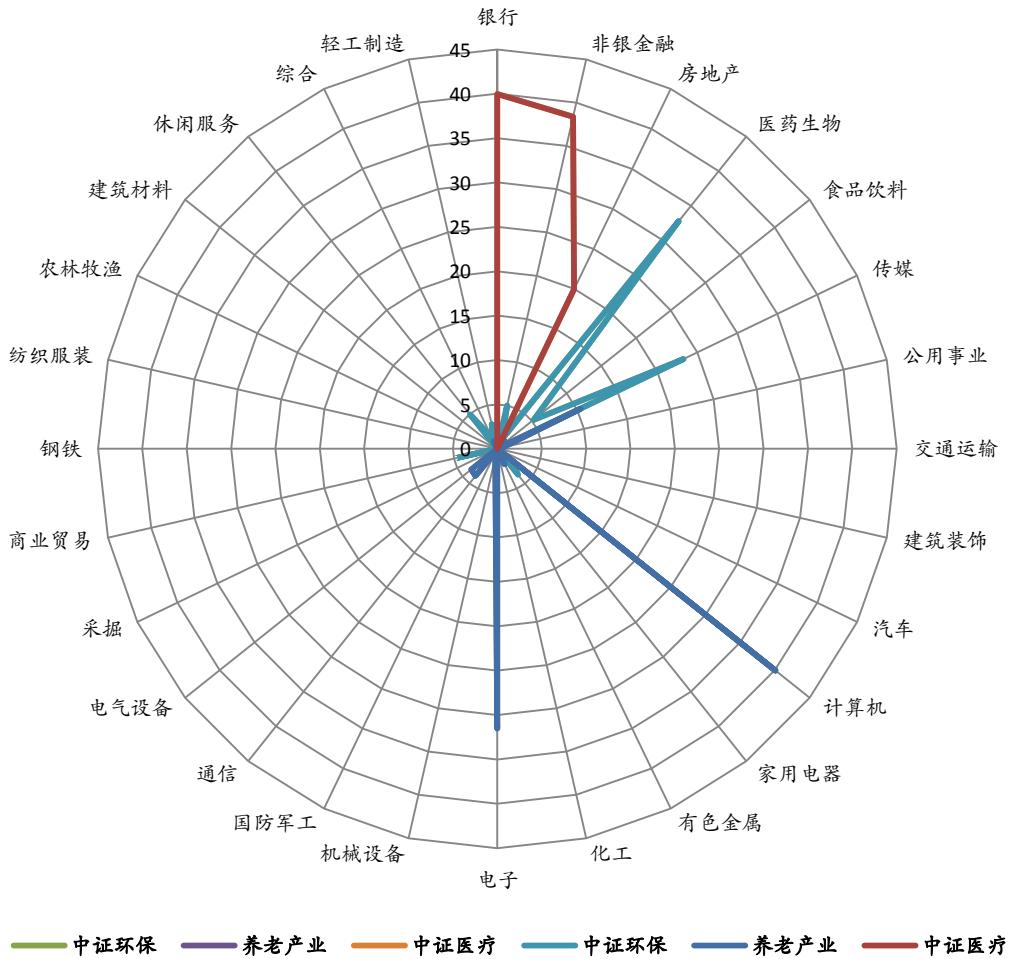
图1 成份行业贡献率与月度涨跌幅

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指数中所占权重居首，为18.5%。医药生物、电子和有色金属行业在中证500指数中权重居前，依次为10.7%、6.61%和6.23%。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12.94%、10.99%和10.06%。房地产、非银金融和传媒行业在深证100指数中权重位列前三，依次为10.94%、10.86%和9.13%。

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 0.875%。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 1.384%，跟踪效果较好。

表 1 基金净值与跟踪误差

基金简称	2016 年 6 月		2016 年 5 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	1.4116	1.7016	1.4023	1.6923	0.7992	2008/12/30
广发中证 500ETF 联接	1.2826	1.2826	1.2436	1.2436	0.7280	2009/11/26

广发中小板 300ETF	1.4779	1.3427	1.4083	1.2795	0.8752	2011/6/3
广发中小板 300 联接	1.2231	1.2231	1.1697	1.1697	1.2099	2011/6/9
广发深证 100 分级	0.9766	1.0958	0.9508	1.0700	2.4042	2012/5/7
广发中证 500ETF	1.6809	1.6809	1.6275	1.6275	0.7416	2013/4/11
广发全指可选消费 ETF	1.4779	1.4779	1.4497	1.4497	0.6251	2014/6/3
广发全指医药卫生 ETF	1.2219	1.2219	1.1751	1.1751	0.3112	2014/12/1
广发全指信息技术 ETF	1.2054	1.2054	1.1396	1.1396	0.2497	2015/1/8
广发中证养老产业	0.9398	0.9398	0.9208	0.9208	1.3837	2015/2/13
广发全指金融地产 ETF	0.7423	0.7423	0.7446	0.7446	1.3366	2015/3/23
广发中证环保产业	0.7372	0.7372	0.7040	0.7040	0.8807	2015/3/25
广发全指原材料 ETF	0.7893	0.7893	0.7537	0.7537	0.5089	2015/6/25
广发全指能源 ETF	0.6147	0.6147	0.6034	0.6034	0.8522	2015/6/25
广发全指主要消费 ETF	0.9213	0.9213	0.8845	0.8845	0.4229	2015/7/1
广发中证医疗分级	1.1630	0.7637	1.1016	0.7240	3.0718	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

6月沪深两市小幅上涨，覆盖两市的申万A指涨幅为2.95%。指数方面，本期核心市场指数中，中小板300涨幅最高，上涨4.75%；上证50表现最差，跌幅为1.53%。

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	2155.66	2155.50	2158.72	2052.98	2122.63	-1.53%	3633.96
上证180	6823.75	6823.06	6857.04	6499.19	6735.89	-1.29%	11621.79
深证成指	10159.93	10184.23	10527.69	9779.11	10489.99	3.25%	32185.66
深证100P	3616.60	3632.01	3704.98	3480.86	3675.42	1.63%	9815.17
中小板指	6653.51	6680.11	6933.13	6439.71	6892.73	3.60%	7753.46
中小板300	1440.99	1444.55	1517.59	1392.46	1509.41	4.75%	19607.16

创业板指	2159.80	2164.73	2238.35	2031.67	2227.79	3.15%	7513.82
沪深 300	3169.56	3172.96	3201.75	3033.97	3153.92	-0.49%	20468.11
中证 500	5947.32	5957.18	6145.00	5692.81	6123.49	2.96%	22353.47
申万 A 指	3395.38	3400.11	3505.24	3274.82	3495.64	2.95%	113898.27

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	1812.62	1811.76	1850.22	1723.53	1839.66	1.49%	1215.28
全指材料	2973.99	2979.31	3138.93	2903.70	3113.64	4.70%	17890.35
全指工业	3700.16	3701.82	3818.88	3551.63	3792.59	2.50%	18996.27
全指可选	5475.16	5493.55	5607.11	5234.53	5557.15	1.50%	13592.10
全指消费	7958.35	7961.95	8314.94	7829.24	8279.47	4.03%	4663.54
全指医药	8941.02	8953.37	9324.79	8594.69	9282.15	3.82%	4517.65
全指金融	5235.67	5238.86	5252.65	5006.99	5176.47	-1.13%	7407.27
全指信息	6276.06	6290.33	6693.95	5974.82	6639.56	5.79%	23143.10
全指电信	5558.10	5561.59	5974.73	5430.96	5916.09	6.44%	2647.79
全指公用	2405.15	2401.53	2429.04	2314.80	2397.90	-0.30%	1386.11
中证全指	4532.85	4538.42	4663.23	4365.47	4650.62	2.60%	107165.14

图3 核心指数月度表现

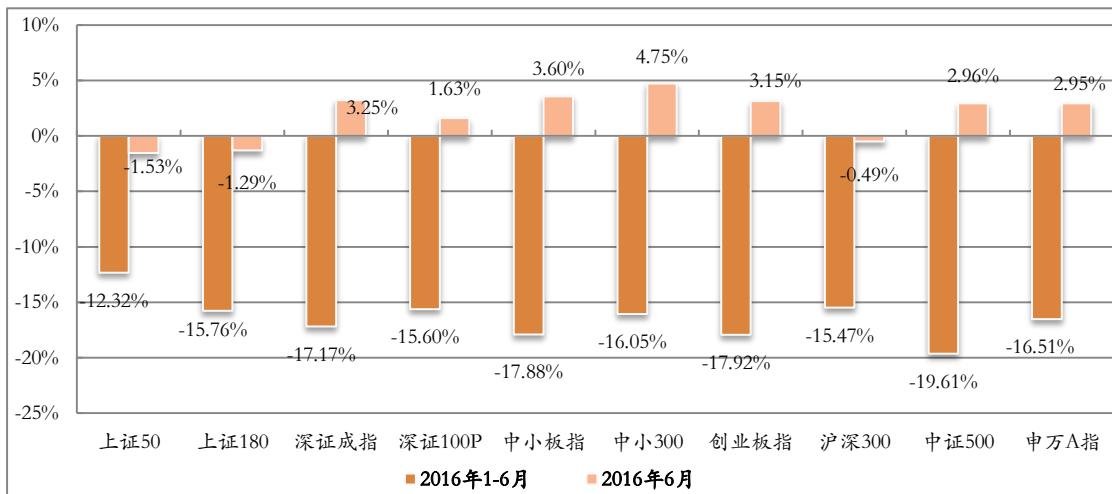


图4 核心指数本月绝对收益

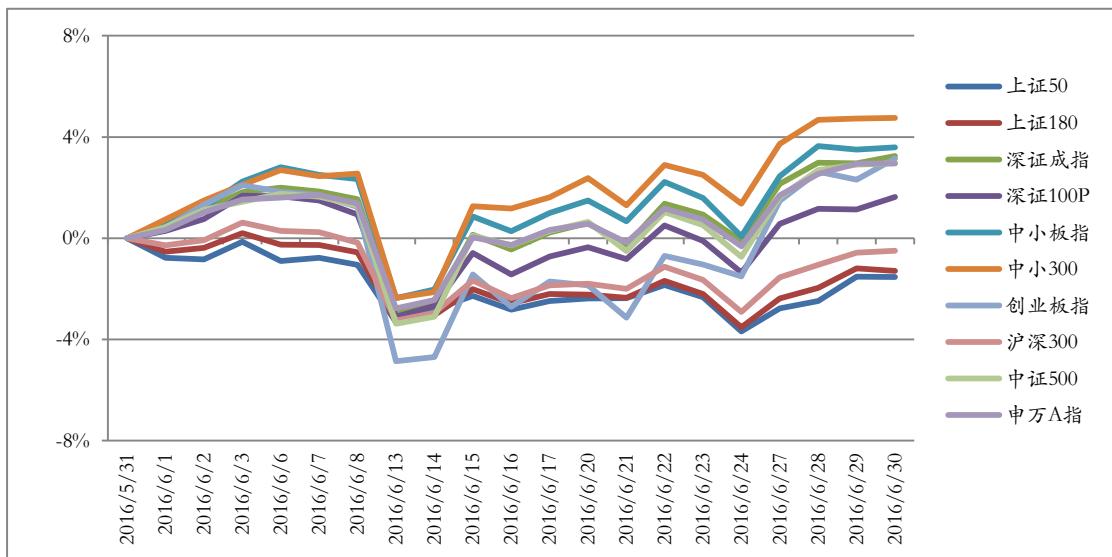
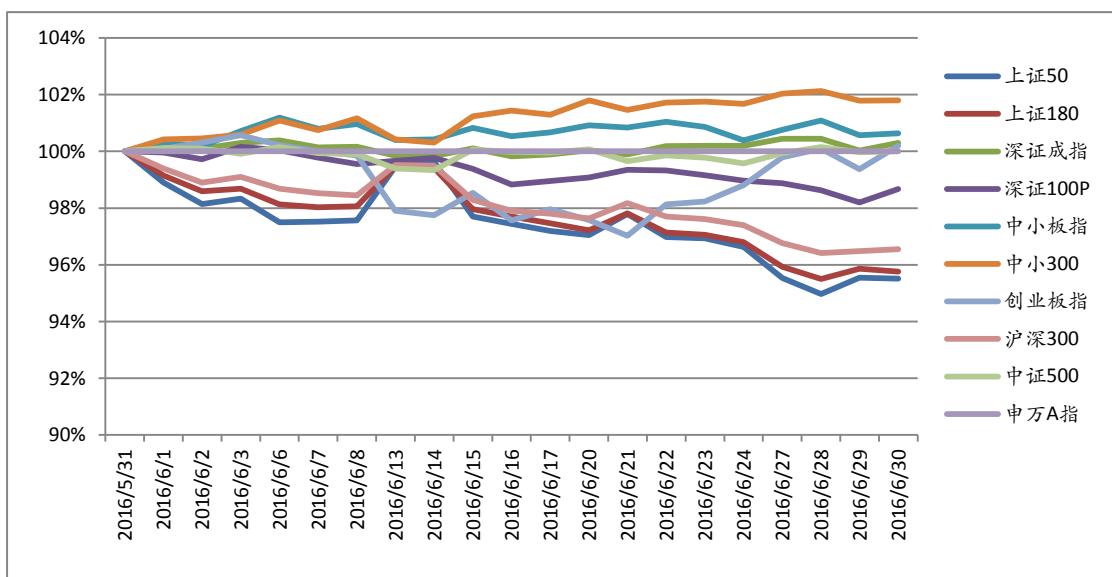


图5 核心指数本月超额收益对比



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

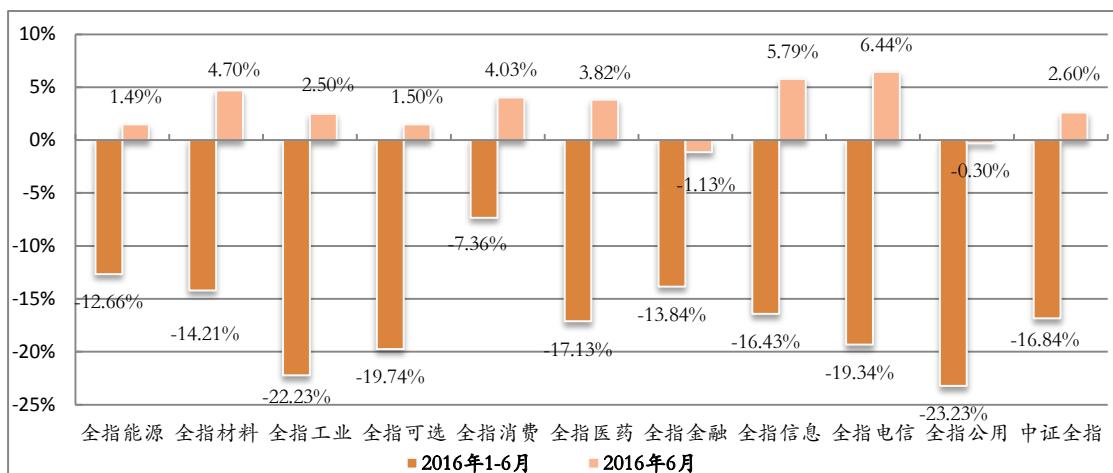


图 7 行业指数本月绝对收益

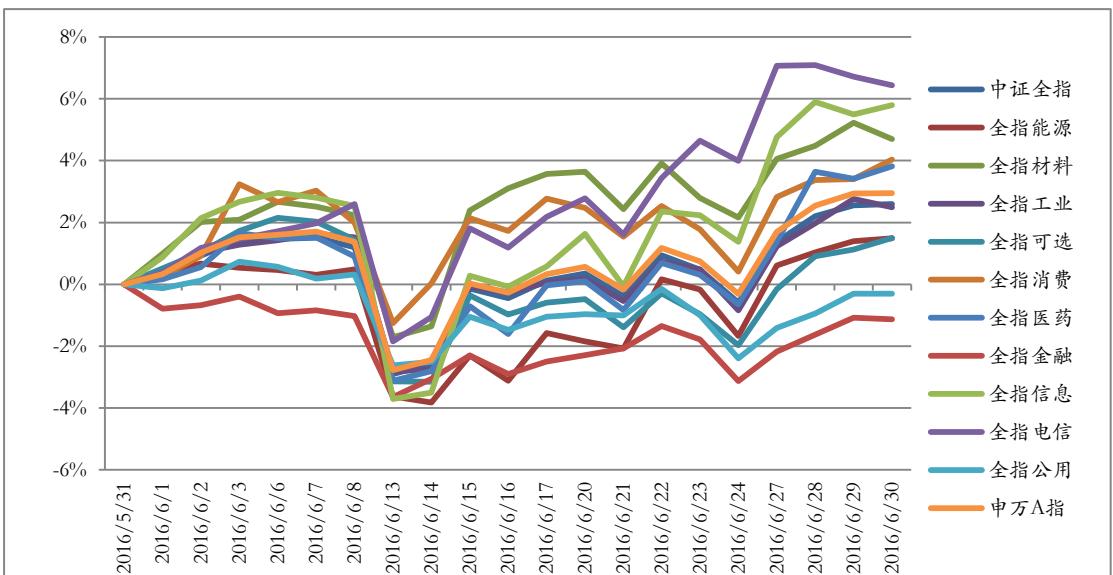
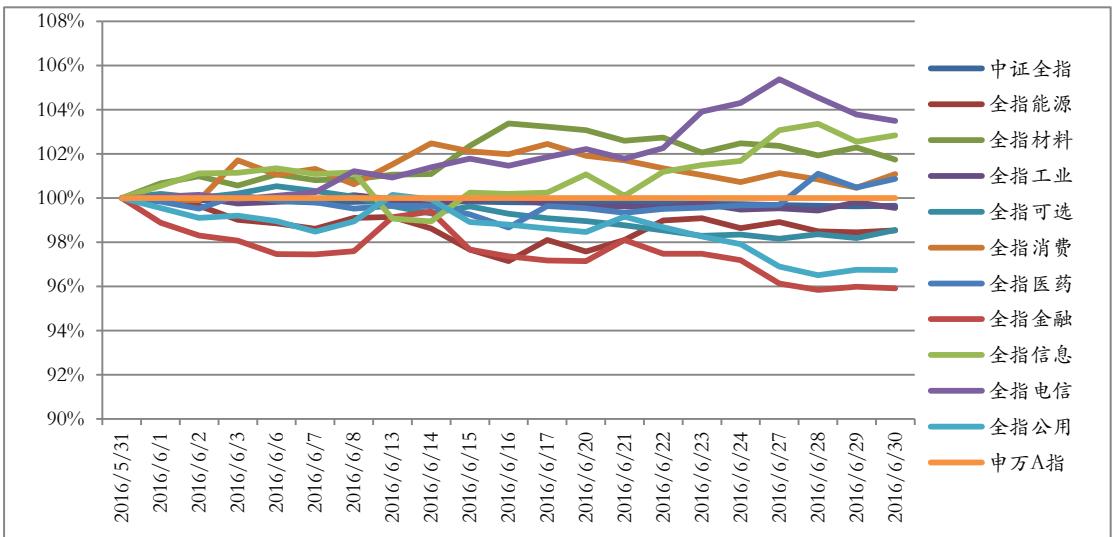


图 8 行业指数本月超额收益对比



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6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15.53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9.10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	31.52	9.04	9.10	1.05
上证180	34.29	9.83	9.73	1.15
深证成指	117.30	28.07	23.64	3.18
深证100	80.51	19.46	18.31	2.59
中小板指	125.26	32.38	26.88	4.39
中小300	162.32	38.73	29.90	4.58
创业板指	344.80	58.12	41.48	8.17
沪深300	39.45	11.14	10.98	1.31
中证500	147.04	34.94	26.65	2.83
申万A指	61.50	17.27	15.53	1.93

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	145.28	32.11	38.49	0.90
全指材料	191.46	46.23	32.59	2.19
全指工业	115.28	25.05	20.52	2.22
全指可选	95.93	23.80	19.53	3.00
全指消费	92.01	28.84	24.49	3.79
全指医药	151.87	39.98	32.00	4.68
全指金融	26.11	7.78	7.64	1.15
全指信息	316.76	57.77	39.38	5.96
全指电信	181.31	45.46	30.87	1.91
全指公用	57.83	14.95	13.46	1.58
中证全指	60.33	16.82	15.23	1.89

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	-2.08	6.13	9.73
600016	民生银行	8.93	0.00	5.62	5.92
601166	兴业银行	15.24	-2.24	6.39	5.70
600036	招商银行	17.50	-2.78	3.91	5.06
601328	交通银行	5.63	1.81	5.55	4.34
贡献前 5 名样本股					
代码	简称	收盘	涨跌幅%	换手率%	贡献点数
600519	贵州茅台	291.92	10.38	12.69	8.17
600887	伊利股份	16.67	8.18	13.14	4.51
601328	交通银行	5.63	1.81	5.55	1.61
601398	工商银行	4.44	1.84	4.57	1.10
601989	中国重工	6.33	2.93	8.22	0.98
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
600519	贵州茅台	291.92	10.38	12.69	8.17
600887	伊利股份	16.67	8.18	13.14	4.51
600109	国金证券	13.48	3.22	47.08	0.45
601989	中国重工	6.33	2.93	8.22	0.98
600893	中航动力	34.65	2.64	25.52	0.41
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
600111	北方稀土	13.31	-11.31	86.76	-2.20
600010	包钢股份	2.86	-6.23	18.90	-1.10
601766	中国中车	9.17	-5.46	13.20	-2.89
601669	中国电建	5.71	-4.99	15.39	-0.74
601336	新华保险	40.40	-4.45	17.78	-0.79

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	-2.08	6.13	5.98
600016	民生银行	8.93	0.00	5.62	3.64
601166	兴业银行	15.24	-2.24	6.39	3.50
600036	招商银行	17.50	-2.78	3.91	3.11
601328	交通银行	5.63	1.81	5.55	2.67
贡献前 5 名样本股					
代码	简称	收盘	涨跌幅%	换手率%	贡献点数
600519	贵州茅台	291.92	10.38	12.69	16.08
600887	伊利股份	16.67	8.18	13.14	8.90
600547	山东黄金	38.91	31.82	140.65	7.78
601899	紫金矿业	3.37	10.13	43.02	3.47
600570	恒生电子	66.77	9.15	194.62	3.24
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
600547	山东黄金	38.91	31.82	140.65	7.78
600489	中金黄金	11.24	16.12	90.52	3.13
600490	鹏欣资源	7.99	11.75	155.43	1.11
600519	贵州茅台	291.92	10.38	12.69	16.08
600060	海信电器	17.68	10.22	42.09	1.51
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
600153	建发股份	12.00	-30.12	88.97	-10.27
600111	北方稀土	13.31	-11.31	86.76	-4.34
600839	四川长虹	4.42	-11.07	80.76	-2.39
600369	西南证券	7.26	-10.48	24.70	-2.78
601377	兴业证券	7.39	-9.55	44.95	-4.48

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	2.64
000651	格力电器	19.22	0.00	0.00	1.67
000333	美的集团	23.72	11.10	20.70	1.39
000001	平安银行	8.70	0.46	10.67	1.26
000858	五粮液	32.53	8.32	28.04	1.10
贡献前 5 名样本股					
代码	简称	收盘	涨跌幅%	换手率%	贡献点数
000333	美的集团	23.72	11.10	20.70	14.57
000783	长江证券	11.60	15.19	68.21	9.88
000858	五粮液	32.53	8.32	28.04	8.83
002736	国信证券	17.25	14.16	39.80	7.71
002340	格林美	8.77	24.40	256.99	7.32
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
300316	晶盛机电	13.10	52.15	220.00	3.05
002474	榕基软件	18.90	46.06	203.54	4.79
300183	东软载波	26.50	38.05	187.64	3.01
300101	振芯科技	27.93	30.94	159.89	4.70
000021	深科技	11.01	29.22	111.90	3.74
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
002219	恒康医疗	11.05	-25.84	45.52	-5.83
000961	中南建设	5.61	-19.47	88.19	-2.66
300157	恒泰艾普	10.79	-18.69	142.25	-2.39
000800	一汽轿车	10.88	-18.01	93.18	-3.87
000831	*ST 五稀	13.18	-17.73	82.61	-3.59

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	5.96
000651	格力电器	19.22	0.00	0.00	3.77
000333	美的集团	23.72	11.10	20.70	3.14
000001	平安银行	8.70	0.46	10.67	2.84
000858	五粮液	32.53	8.32	28.04	2.48
贡献前 5 名样本股					
代码	简称	收盘	涨跌幅%	换手率%	贡献点数
000333	美的集团	23.72	11.10	20.70	11.54
000783	长江证券	11.60	15.19	68.21	7.83
000858	五粮液	32.53	8.32	28.04	6.99
002736	国信证券	17.25	14.16	39.80	6.11
000568	泸州老窖	29.70	21.03	48.76	5.53
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
300002	神州泰岳	10.64	21.18	68.07	2.94
000568	泸州老窖	29.70	21.03	48.76	5.53
000839	中信国安	21.31	17.54	155.99	5.31
002405	四维图新	24.60	15.32	187.24	4.07
000783	长江证券	11.60	15.19	68.21	7.83
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
000800	一汽轿车	10.88	-18.01	93.18	-3.06
000831	*ST 五稀	13.18	-17.73	82.61	-2.84
000970	中科三环	14.51	-10.04	174.21	-2.22
300104	乐视网	52.91	-9.97	119.73	-8.96
300027	华谊兄弟	13.54	-9.25	75.37	-3.33

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	10.86	-1.45	41.29	3.65
002450	康得新	17.10	3.89	40.38	3.38
002415	海康威视	21.46	1.66	16.76	3.26
002304	洋河股份	71.92	7.86	14.59	3.06
002594	比亚迪	61.01	2.02	29.09	2.57
贡献前 5 名样本股					
代码	简称	收盘	涨跌幅%	换手率%	贡献点数
002736	国信证券	17.25	14.16	39.80	21.38
002340	格林美	8.77	24.40	256.99	20.28
002230	科大讯飞	32.85	13.16	102.59	17.83
002304	洋河股份	71.92	7.86	14.59	15.81
002405	四维图新	24.60	15.32	187.24	14.26
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	8.77	24.40	256.99	20.28
002191	劲嘉股份	11.59	19.24	76.16	8.89
002273	水晶光电	27.99	16.92	199.80	9.39
002428	云南锗业	17.18	16.55	156.13	5.91
002185	华天科技	12.73	15.82	107.72	6.26
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
002219	恒康医疗	11.05	-25.84	45.52	-16.15
002573	清新环境	16.92	-7.59	64.26	-4.78
002269	美邦服饰	4.40	-7.56	33.69	-2.15
002311	海大集团	15.77	-6.96	37.44	-4.19
002437	誉衡药业	8.70	-5.61	49.50	-2.09

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	10.86	-1.45	41.29	1.88
002450	康得新	17.10	3.89	40.38	1.75
002415	海康威视	21.46	1.66	16.76	1.68
002304	洋河股份	71.92	7.86	14.59	1.58
002594	比亚迪	61.01	2.02	29.09	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
002736	国信证券	17.25	14.16	39.80	2.42
002340	格林美	8.77	24.40	256.99	2.29
002230	科大讯飞	32.85	13.16	102.59	2.02
002304	洋河股份	71.92	7.86	14.59	1.79
002405	四维图新	24.60	15.32	187.24	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
002474	榕基软件	18.90	46.06	203.54	1.50
002371	七星电子	41.82	39.27	217.36	1.26
002521	齐峰新材	11.44	33.65	187.02	0.72
002240	威华股份	13.36	28.09	253.55	0.59
002079	苏州固锝	11.17	27.07	219.42	0.68
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
002219	恒康医疗	11.05	-25.84	45.52	-1.83
002358	森源电气	15.43	-13.56	111.28	-0.51
002496	辉丰股份	5.85	-13.20	121.70	-0.40
002229	鸿博股份	25.08	-12.49	187.55	-0.44
002463	沪电股份	5.28	-12.44	82.75	-0.51

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	52.91	-9.97	119.73	5.27
300059	东方财富	22.20	0.95	120.31	4.61
300017	网宿科技	67.20	0.21	44.08	3.18
300024	机器人	25.39	-0.70	59.82	2.77
300070	碧水源	14.88	-3.38	21.67	2.22
贡献前 5 名样本股					
代码	简称	收盘	涨跌幅%	换手率%	贡献点数
300101	振芯科技	27.93	30.94	159.89	5.39
300136	信维通信	20.96	17.16	60.40	4.48
300002	神州泰岳	10.64	21.18	68.07	4.27
300159	新研股份	18.05	21.22	65.80	4.12
300156	神雾环保	20.58	20.00	49.28	3.94
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
300101	振芯科技	27.93	30.94	159.89	5.39
300053	欧比特	18.15	28.09	203.10	3.73
300026	红日药业	17.39	22.55	78.80	3.09
300075	数字政通	25.65	22.07	173.76	2.53
300159	新研股份	18.05	21.22	65.80	4.12
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
300043	互动娱乐	14.17	-10.32	52.07	-2.06
300104	乐视网	52.91	-9.97	119.73	-12.99
300027	华谊兄弟	13.54	-9.25	75.37	-4.82
300413	快乐购	24.35	-7.69	118.67	-0.35
300113	顺网科技	37.96	-7.44	101.68	-2.46

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
600519	贵州茅台	291.92	10.38	12.69	5.13
600887	伊利股份	16.67	8.18	13.14	2.86
000333	美的集团	23.72	11.10	20.70	2.82
600547	山东黄金	38.91	31.82	140.65	2.49
002736	国信证券	17.25	14.16	39.80	2.05
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	38.91	31.82	140.65	2.49
300002	神州泰岳	10.64	21.18	68.07	0.83
000568	泸州老窖	29.70	21.03	48.76	1.34
600188	兖州煤业	10.94	17.62	61.42	0.24
601225	陕西煤业	5.17	16.70	55.67	0.55
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
600153	建发股份	12.00	-30.12	88.97	-3.28
000800	一汽轿车	10.88	-18.01	93.18	-0.71
600111	北方稀土	13.31	-11.31	86.76	-1.39
600839	四川长虹	4.42	-11.07	80.76	-0.76
600369	西南证券	7.26	-10.48	24.70	-0.89

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%
002466	天齐锂业	42.69	-4.07	199.94	0.68
600584	长电科技	20.29	7.59	99.89	0.57
002405	四维图新	24.60	15.32	187.24	0.56
002340	格林美	8.77	24.40	256.99	0.48
600522	中天科技	9.80	8.30	85.06	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
002340	格林美	8.77	24.40	256.99	6.21
002405	四维图新	24.60	15.32	187.24	4.84
000997	新大陆	20.04	18.57	85.27	3.62
600436	片仔癀	45.01	18.48	51.31	3.55
002371	七星电子	41.82	39.27	217.36	3.52
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
600006	东风汽车	8.87	41.13	184.21	3.52
002371	七星电子	41.82	39.27	217.36	3.52
603806	福斯特	52.19	38.77	283.18	1.60
000021	深科技	11.01	29.22	111.90	3.06
002221	东华能源	12.19	25.28	39.98	3.37
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
600122	宏图高科	13.38	-30.96	73.00	-9.08
000961	中南建设	5.61	-19.47	88.19	-2.53
600392	盛和资源	16.38	-15.09	255.69	-2.63
600259	广晟有色	57.26	-14.66	164.30	-2.45
002358	森源电气	15.43	-13.56	111.28	-1.44

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	-2.08	6.13	1.73
600016	民生银行	8.93	0.00	5.62	1.20
601166	兴业银行	15.24	-2.24	6.39	1.00
600036	招商银行	17.50	-2.78	3.91	0.87
600519	贵州茅台	291.92	10.38	12.69	0.74
贡献前 5 名样本股					
代码	简称	收盘	涨跌幅%	换手率%	贡献点数
600519	贵州茅台	291.92	10.38	12.69	2.44
000333	美的集团	23.72	11.10	20.70	1.58
600887	伊利股份	16.67	8.18	13.14	1.37
600547	山东黄金	38.91	31.82	140.65	1.29
000858	五粮液	32.53	8.32	28.04	0.82
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
002798	帝王洁具	86.70	289.14	392.64	0.28
002352	鼎泰新材	48.08	217.15	304.50	0.51
603779	威龙股份	41.96	121.78	541.66	0.23
300508	维宏股份	254.50	100.76	620.81	0.30
300432	富临精工	35.87	88.99	246.74	0.44
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
002612	朗姿股份	24.93	-33.75	137.42	-0.31
000717	*ST 韶钢	2.97	-32.50	33.98	-0.32
600122	宏图高科	13.38	-30.96	73.00	-0.99
600153	建发股份	12.00	-30.12	88.97	-1.61
600230	*ST 沧大	9.91	-29.11	50.80	-0.12

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:

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

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:

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

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:

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

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。