

# 指数基金中的跟踪误差是什么—什么是指数基金跟踪误差？-股识吧

## 一、请问“跟踪误差”是什么意思？

我不知道你问的是哪个领域的，我是从控制论，信号处理角度解释。tracking error，就是对某个对象进行跟踪时预测值和真实值之间的差别。仅仅说tracking，可以出现很多领域，比如控制里面，股票里面等。

## 二、什么是跟踪误差，跟踪误差的计算公式

指数型基金复制是否好，看跟踪误差即可。  
跟踪误差较好的基金如嘉实沪深300、易方达深证100ETF等都在这方面做得不错。我们判断现阶段是一个筑底时期，适合定投基金。

## 三、什么是指数基金跟踪误差？

指数基金的跟踪误差，指的是指数基金的收益率与标的指数收益率之间的偏差，用来描述基金与标的指数之间的密切程度，同时揭示基金收益率围绕标的指数收益率的波动特征。

一般来说，跟踪误差的准确性与观察周期的长短有关，观察周期越长，观察点越多，计算出的跟踪误差就越准确。

简单说，跟踪误差就是指数基金走势，和它跟踪的指数走势出现的偏差。

比如在一年内，沪深300指数上涨了20%，而一只跟踪沪深300指数的基金只上涨了15%，即出现了较大的跟踪误差。

这种情况对投资者很不利，所以选择指数基金，跟踪误差越小越好。

任何指数基金都难以做到与基准指数完全同步且一致的配置，所以，跟踪误差是绝对存在的，影响指数基金跟踪误差的主要因素包括投资者申购赎回引起的基金仓位的变化，指数成分股调整、停牌、交易受限以及指数增强等原因引起的阶段性结构差异，指数成分股流动性不足造成的成本差异，指数成分股分红、重新估值以及各种费用的支出引起的收益性损益。

跟踪误差是如何产生的？指数基金跟踪误差产生的原因有很多：比如大额申购赎回、股票分红、指数成分股变动和基金费率等。

下面简单以指大额申购为例说明。

为了应对投资者的申购和赎回，指数基金通常会预留一部分现金比例。

假设一个指数基金最近的表现非常优秀，吸引大批投资者前来申购。

但是基金经理拿这些资金购买股票是需要时间的，如果资金过多或市场短期大涨，就会导致指数基金落后指数。

如何查询跟踪误差？我们可以通过指数基金的定期报告来查询。

每一个指数基金，基金公司都会发布定期报告，主要包括：4份季度报告、1份半年报和1份年报。

基金报告能在基金官网和代销平台查到。

查询方法通常是找到一只具体的指数基金，然后依次寻找：基金档案 基金公告  
定期报告，不同平台可能略有差异。

## 四、指数基金的跟踪误差

指数型基金复制是否好，看跟踪误差即可。

跟踪误差较好的基金如嘉实沪深300、易方达深证100ETF等都在这方面做得不错。

我们判断现阶段是一个筑底时期，适合定投基金。

## 五、基金净值的跟踪误差一般是多少？

投资者需重点观察指数基金的跟踪误差，选择跟踪误差小的指数基金投资。

指数基金跟踪误差有三个方面：现金头寸、结构化差异和成本因素，任何一个环节控制不到位，就会扩大跟踪误差。

一般而言，跟踪误差越小，表明基金经理的管理能力越强。

## 参考文档

[下载：指数基金中的跟踪误差是什么.pdf](#)

[《股票需要多久出舱》](#)

[《滴滴上市股票多久可以交易》](#)

[《股票停牌多久能恢复》](#)

[《股票上升趋势多久比较稳固》](#)

[下载：指数基金中的跟踪误差是什么.doc](#)

[更多关于《指数基金中的跟踪误差是什么》的文档...](#)

声明：

本文来自网络，不代表

【股识吧】立场，转载请注明出处：

<https://www.gupiaozhishiba.com/article/75944111.html>