

成分股监测报告

2022年2月16日 星期三

兴证期货·研发中心

金融研究团队

林玲

从业资格编号：F3067533

投资咨询编号：Z0014903

杨娜

从业资格编号：F03091213

投资咨询编号：Z0016895

联系人

杨娜

邮箱：

yangna@xzfutures.com

内容提要

● 我们的观点

2021年2月7日至11日，沪深300指数下跌37.18点。对IF指数周度跌幅提供负贡献排名前三的行业分别为：银行、非银金融、有色金属；对IF指数周度跌幅提供正贡献排名前三的行业分别为：电气设备、电子、医药生物。上证50指数上涨40.29点。对IH指数周度涨幅提供负贡献排名前三的行业分别为：医药生物、电气设备、食品饮料；对IH指数周度涨幅提供正贡献排名前三的行业分别为：非银金融、银行、公用事业。中证500指数上涨80.46点。对IC指数周度涨幅提供负贡献排名前三的行业分别为：电子、电气设备、医药生物；对IC指数周度涨幅提供正贡献排名前三的行业分别为：有色金属、采掘、公用事业。

北上资金净流入107.44亿元，统计每日北上资金前十大活跃股个股成交情况，周内合计净流入87.83亿元。在每日前十大活跃股中，沪深300指数300只成分股中有33只股票有北上资金参与，周内北上资金净买入87.83亿元，其中买入647.5亿元，卖出559.66亿元；上证50指数50只成分股中有13只股票有北上资金参与，周内净买入91.16亿元，其中买入327.32亿元，卖出236.15亿元；中证500指数成分股中无北上资金参与。

报告目录

1. 成分股指数拉动情况.....	3
2. 北上资金个股流向.....	7

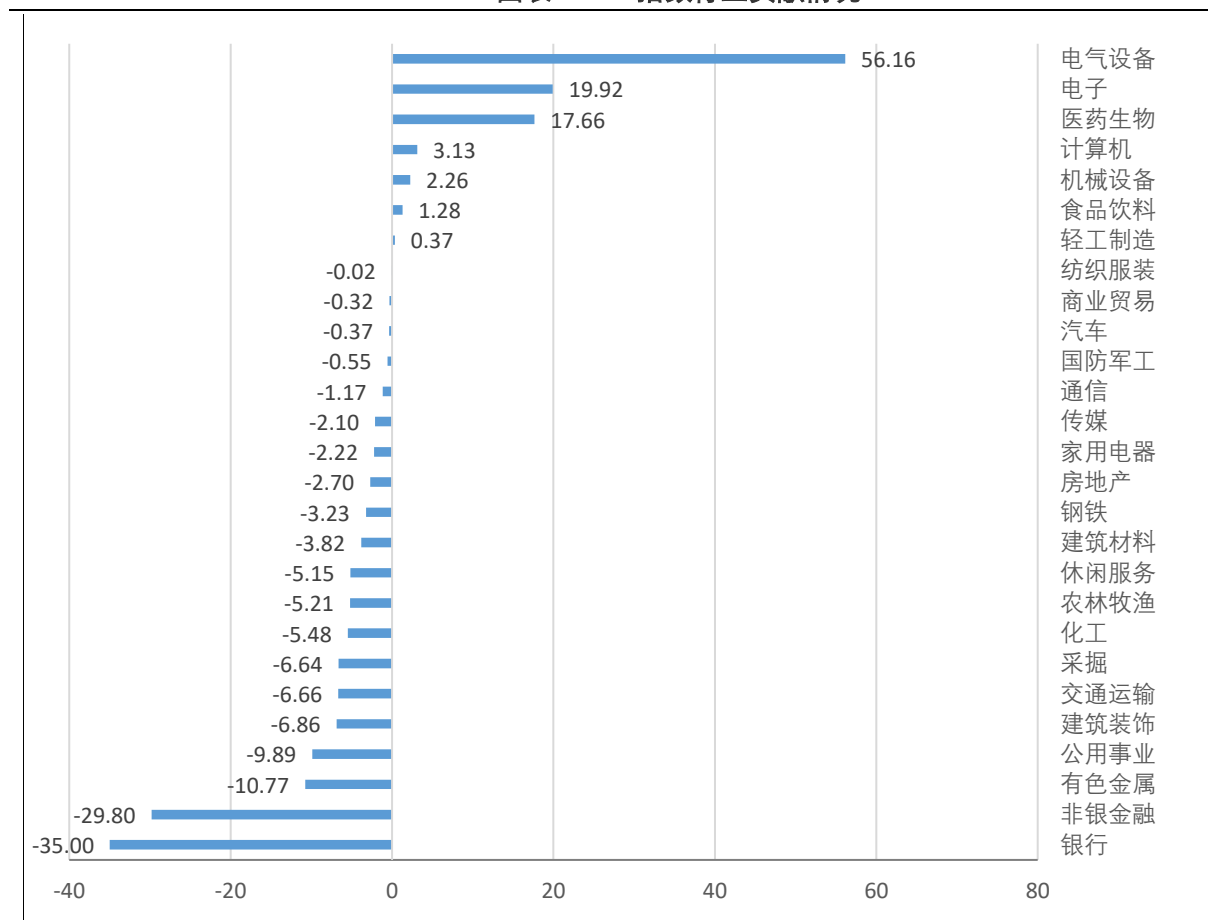
图表目录

图表 1: IF 指数行业贡献情况.....	3
图表 2: IF 指数正/负贡献最大公司.....	4
图表 3: IH 指数行业贡献情况.....	5
图表 4: IH 指数正/负贡献最大公司.....	5
图表 5: IC 指数行业贡献情况.....	6
图表 6: IC 指数正/负贡献最大公司.....	7
图表 7: IF 北上资金流入情况.....	8
图表 8: IH 北上资金流入情况.....	9

1. 成分股指数拉动情况

2021年2月7日至11日，沪深300指数下跌37.18点。在沪深300指数的300只成分股中，有201只股票对指数下跌提供负贡献，有99只股票提供正贡献。分行业看，对IF指数周度跌幅提供负贡献排名前三的行业分别为：银行、非银金融、有色金属；对IF指数周度跌幅提供正贡献排名前三的行业分别为：电气设备、电子、医药生物。分个股看，对IF指数周度跌幅提供负贡献排名前五的股票分别为：中国平安、招商银行、兴业银行、长江电力、中国中免；对指数周度跌幅提供贡献点分别为：-14.59点，-10.13点，-6.6点，-5.06点，-4.48点。对IF指数周度跌幅提供正贡献排名前五的股票分别为：宁德时代、药明康德、立讯精密、隆基股份、贵州茅台；对指数周度跌幅提供贡献点分别为：32.34点，10.86点，7.1点，6.1点，5.94点。

图表 1: IF 指数行业贡献情况



数据来源: wind, 兴证期货研发部

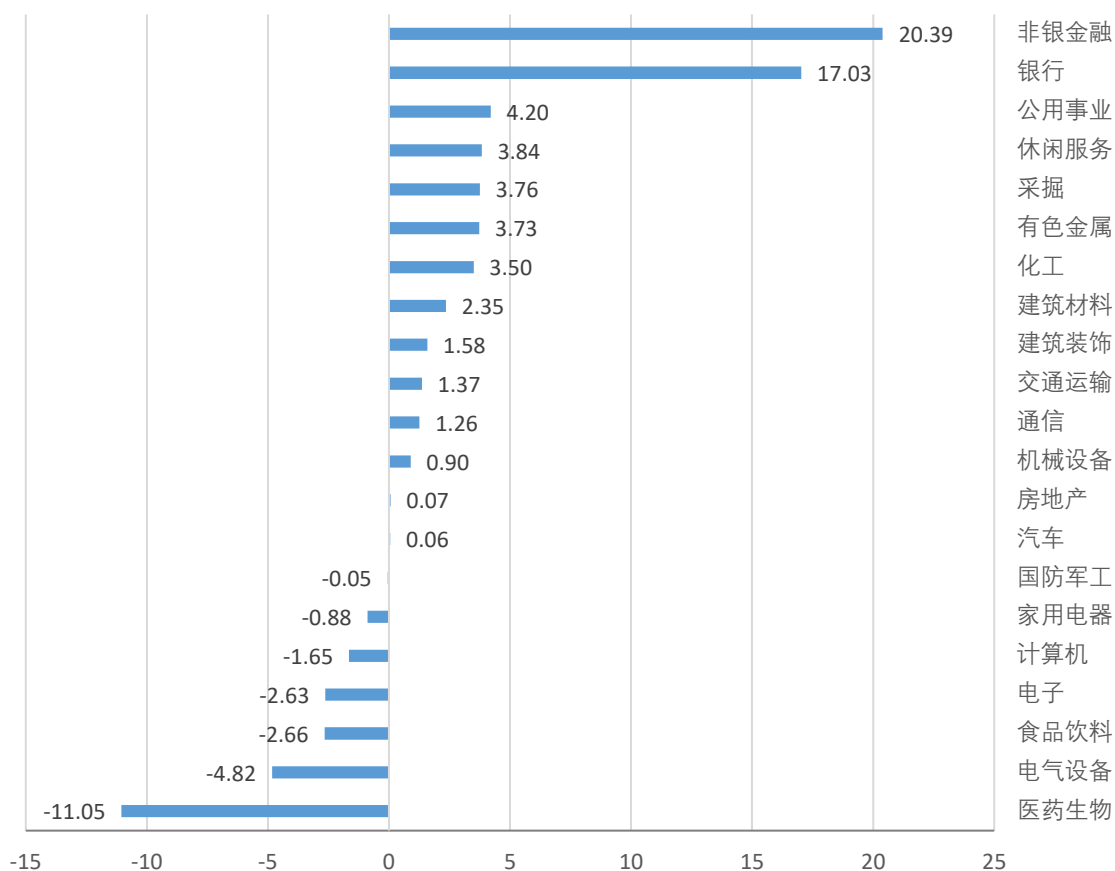
图表 2: IF 指数正/负贡献最大公司

	负贡献		正贡献	
	公司简称	点数	公司简称	点数
1	中国平安	-14.59	宁德时代	32.34
2	招商银行	-10.13	药明康德	10.86
3	兴业银行	-6.60	立讯精密	7.10
4	长江电力	-5.06	隆基股份	6.10
5	中国中免	-4.48	贵州茅台	5.94
6	紫金矿业	-4.43	阳光电源	5.01
7	智飞生物	-3.25	歌尔股份	4.04
8	万华化学	-3.18	韦尔股份	3.98
9	智飞生物	-3.25	恩捷股份	3.67
10	万华化学	-3.18	迈瑞医疗	3.23

数据来源: wind, 兴证期货研发部

2021年2月7日至11日, 上证50指数上涨40.29点。在上证50指数的50只成分股中, 有12只股票对指数上涨提供负贡献, 有38只股票提供正贡献。分行业看, 对IH指数周度涨幅提供负贡献排名前三的行业分别为: 医药生物、电气设备、食品饮料; 对IH指数周度涨幅提供正贡献排名前三的行业分别为: 非银金融、银行、公用事业。分个股看, 对IH指数周度涨幅提供负贡献排名前五的股票分别为: 药明康德、隆基股份、贵州茅台、韦尔股份、片仔癀; 对指数周度涨幅提供贡献点分别为: -9.88点, -5.18点, -4.95点, -3.33点, -1.25点。对IH指数周度涨幅提供正贡献排名前五的股票分别为: 中国平安、招商银行、兴业银行、长江电力、中国中免; 对指数周度涨幅提供贡献点分别为: 12.04点, 8.52点, 5.48点, 4.2点, 3.84点。

图表 3: IH 指数行业贡献情况



数据来源: wind, 兴证期货研发部

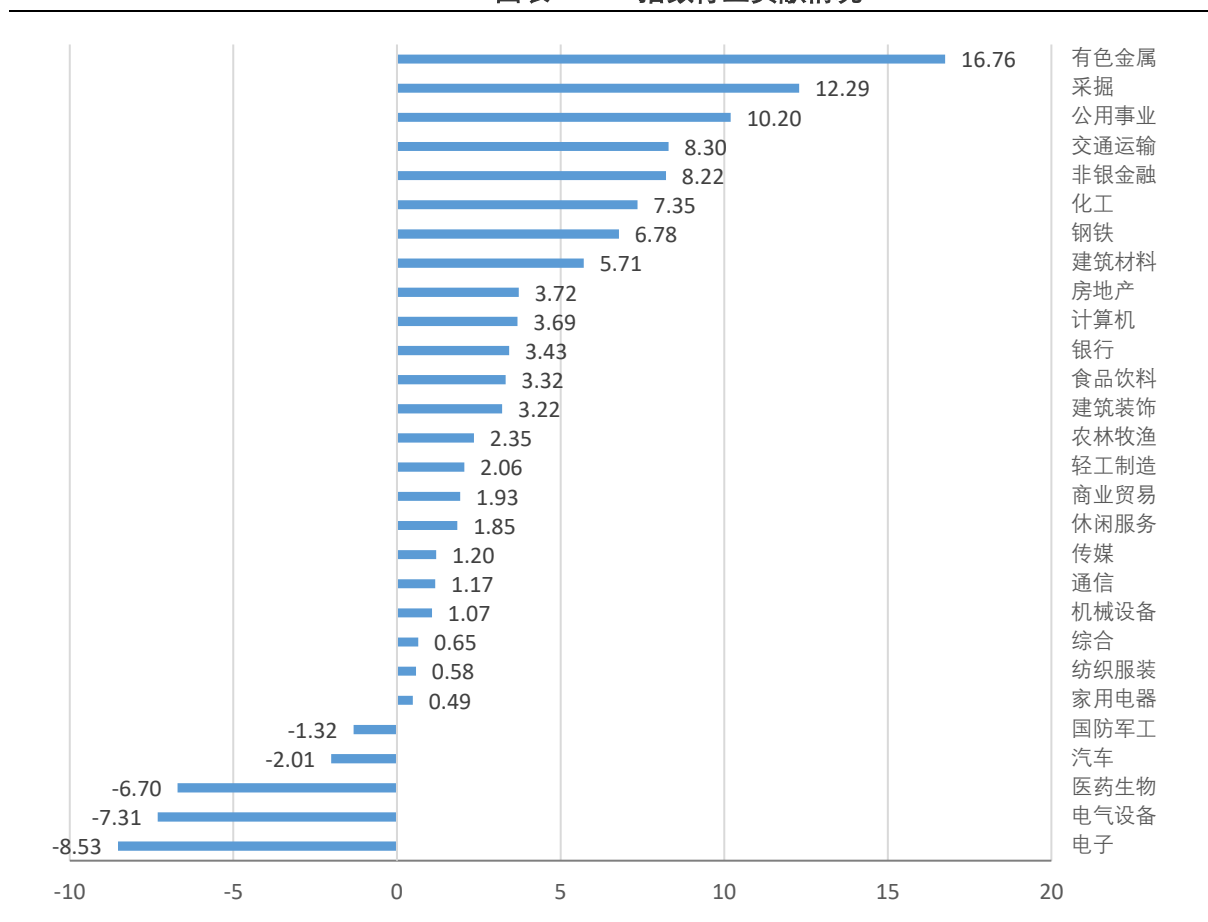
图表 4: IH 指数正/负贡献最大公司

	负贡献		正贡献	
	公司简称	点数	公司简称	点数
1	药明康德	-9.88	中国平安	12.04
2	隆基股份	-5.18	招商银行	8.52
3	贵州茅台	-4.95	兴业银行	5.48
4	韦尔股份	-3.33	长江电力	4.20
5	片仔癀	-1.25	中国中免	3.84
6	恒生电子	-1.19	紫金矿业	3.65
7	海尔智家	-0.88	万华化学	2.68
8	用友网络	-0.46	海螺水泥	2.35
9	海天味业	-0.45	中国神华	2.31
10	长城汽车	-0.37	中信证券	1.95

数据来源: wind, 兴证期货研发部

2021年2月7日至11日，中证500指数上涨80.46点。在中证500指数的500只成分股中，有116只股票对指数上涨提供负贡献，有383只股票提供正贡献，有1只股票贡献为0。分行业看，对IC指数周度涨幅提供负贡献排名前三的行业分别为：电子、电气设备、医药生物；对IC指数周度涨幅提供正贡献排名前三的行业分别为：有色金属、采掘、公用事业。分个股看，对IC指数周度涨幅提供负贡献排名前五的股票分别为：博腾股份、雅克科技、宏发股份、道通科技、锦浪科技；对指数周度涨幅提供贡献点分别为：-3.1点，-2点，-1.8点，-1.61点，-1.6点。对IC指数周度涨幅提供正贡献排名前五的股票分别为：兖矿能源、云铝股份、广汇能源、西部矿业、铜陵有色；对指数周度涨幅提供贡献点分别为：3.14点，2.37点，2.33点，2.23点，2.19点。

图表 5: IC 指数行业贡献情况



数据来源: wind, 兴证期货研发部

图表 6: IC 指数正/负贡献最大公司

	负贡献		正贡献	
	公司简称	点数	公司简称	点数
1	博腾股份	-3.10	兖矿能源	3.14
2	雅克科技	-2.00	云铝股份	2.37
3	宏发股份	-1.80	广汇能源	2.33
4	道通科技	-1.61	西部矿业	2.23
5	锦浪科技	-1.60	铜陵有色	2.19
6	法拉电子	-1.59	旗滨集团	2.12
7	容百科技	-1.49	山西焦煤	1.77
8	明阳智能	-1.39	永泰能源	1.58
9	抚顺特钢	-1.31	锡业股份	1.56
10	长信科技	-1.30	内蒙华电	1.49

数据来源: wind, 兴证期货研发部

2. 北上资金个股流向

2021年2月7日至11日当周,北上资金净流入107.44亿元,统计每日北上资金前十大活跃股个股成交情况,周内合计净流入87.83亿元。在每日前十大活跃股中,沪深300指数300只成分股中有33只股票有北上资金参与,周内北上资金净买入87.83亿元,其中买入647.5亿元,卖出559.66亿元;上证50指数50只成分股中有13只股票有北上资金参与,周内净买入91.16亿元,其中买入327.32亿元,卖出236.15亿元;中证500指数500只成分股中无北上资金参与。

图表 7: IF 北上资金流入情况

代码	简称	权重	贡献点	买入金额	卖出金额	净买入
600519.SH	贵州茅台	5.8358	2.19	53.31	43.42	9.89
300750.SZ	宁德时代	3.6037	0.11	84.56	104.43	-19.88
600036.SH	招商银行	2.7107	1.13	41.84	17.94	23.91
601318.SH	中国平安	2.5024	0.34	54.08	22.77	31.31
000858.SZ	五粮液	1.9653	1.78	25.83	23.56	2.27
601012.SH	隆基股份	1.6645	-2.24	26.94	42.31	-15.38
300059.SZ	东方财富	1.3431	-0.93	14.66	12.43	2.23
601166.SH	兴业银行	1.2601	-0.95	34.95	20.44	14.51
600900.SH	长江电力	1.1764	-0.24	4.51	2.55	1.96
002475.SZ	立讯精密	1.1398	-2	30.15	20.93	9.22
002594.SZ	比亚迪	1.1128	-0.14	24.69	21.34	3.36
603259.SH	药明康德	1.0107	-1.44	24.56	31.83	-7.27
601888.SH	中国中免	0.9466	1.58	18.41	14.58	3.83
600887.SH	伊利股份	0.9439	0	7.28	5.09	2.19
000568.SZ	泸州老窖	0.8315	0.11	3.71	3.84	-0.13
000651.SZ	格力电器	0.8054	-0.87	5.89	3.72	2.17
603501.SH	韦尔股份	0.7332	-0.96	16.64	17.80	-1.16
000001.SZ	平安银行	0.7322	0.04	9.88	10.82	-0.94
002714.SZ	牧原股份	0.6889	-1.27	12.28	14.07	-1.79
601899.SH	紫金矿业	0.6412	0.45	34.91	12.61	22.30
300274.SZ	阳光电源	0.6376	0.63	28.21	23.97	4.24
002812.SZ	恩捷股份	0.6173	-0.35	18.48	24.27	-5.79
002241.SZ	歌尔股份	0.617	-0.92	17.47	8.22	9.26
300014.SZ	亿纬锂能	0.5725	0.46	7.62	6.79	0.83
601919.SH	中远海控	0.5619	-1.14	3.43	2.56	0.86
002460.SZ	赣锋锂业	0.4928	0.22	13.81	22.98	-9.17
600406.SH	国电南瑞	0.4862	-0.82	3.66	3.75	-0.10
600585.SH	海螺水泥	0.453	-0.75	6.45	2.25	4.20
600111.SH	北方稀土	0.4376	0.2	2.09	4.14	-2.04
002027.SZ	分众传媒	0.3892	-0.25	4.44	3.45	1.00
002371.SZ	北方华创	0.3757	-0.63	3.51	3.62	-0.11
300450.SZ	先导智能	0.3548	0.01	5.05	4.17	0.88
002821.SZ	凯莱英	0.2603	-0.1	4.18	3.02	1.15

数据来源: wind, 兴证期货研发部

图表 8: IH 北上资金流入情况

代码	简称	权重	贡献点	买入金额	卖出金额	净买入
600519.SH	贵州茅台	16.079	4.07	53.31	43.42	9.89
600036.SH	招商银行	7.529	2.12	41.84	17.94	23.91
601318.SH	中国平安	6.819	0.62	54.08	22.77	31.31
601012.SH	隆基股份	4.661	-4.22	26.94	42.31	-15.38
601166.SH	兴业银行	3.458	-1.76	34.95	20.44	14.51
600900.SH	长江电力	3.223	-0.45	4.51	2.55	1.96
603259.SH	药明康德	3.037	-2.91	24.56	31.83	-7.27
601888.SH	中国中免	2.675	3.01	18.41	14.58	3.83
600887.SH	伊利股份	2.651	0	7.28	5.09	2.19
603501.SH	韦尔股份	2.024	-1.78	16.64	17.80	-1.16
601899.SH	紫金矿业	1.746	0.83	34.91	12.61	22.30
601919.SH	中远海控	1.477	-2.02	3.43	2.56	0.86
600585.SH	海螺水泥	1.208	-1.35	6.45	2.25	4.20

数据来源: wind, 兴证期货研发部

分析师承诺

本人以勤勉的职业态度，独立、客观地出具本报告。本报告清晰地反映了本人的研究观点。报告所采用的数据均来自公开资料，分析逻辑基于本人的职业理解，通过合理判断的得出结论，力求客观、公正，结论，不受任何第三方的授意影响。本人不曾因也将不会因本报告中的具体推荐意见或观点而直接或间接接收到任何形式的报酬。

免责声明

本报告的信息均来源于公开资料，我公司对这些信息的准确性和完整性不作任何保证，也不保证所包含的信息和建议不会发生任何变更。文中的观点、结论和建议仅供参考。兴证期货可发出其它与本报告所载资料不一致及有不同结论的报告。本报告及该等报告反映编写分析员的不同设想、见解及分析方法。报告所载资料、意见及推测仅反映分析员于发出此报告日期当日的独立判断。

客户不应视本报告为作出投资决策的惟一因素。本报告中所指的投资及服务可能不适合个别客户，不构成客户私人咨询建议。本公司未确保本报告充分考虑到个别客户特殊的投资目标、财务状况或需要。本公司建议客户应考虑本报告的任何意见或建议是否符合其特定状况，以及（若有必要）咨询独立投资顾问。

在任何情况下，本报告中的信息或所表述的意见并不构成对任何人的投资建议。在任何情况下，本公司不对任何人因使用本报告中的任何内容所引致的损失负任何责任。

本报告的观点可能与资管团队的观点不同或对立，对于基于本报告全面或部分做出的交易、结果，不论盈利或亏损，兴证期货研究发展部不承担责任。

本报告版权仅为兴证期货有限公司所有，未经书面许可，任何机构和个人不得以任何形式翻版、复制和发布。如引用、刊发，需注明出处兴证期货研究发展部，且不得对本报告进行有悖原意的引用、删节和修改。