

成分股监测报告

2022年3月2日 星期三

兴证期货·研发中心

金融研究团队

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

2022年2月21日至25日，沪深300指数下跌72.63点。对IF指数周度跌幅提供负贡献排名前三的行业分别为：食品饮料、非银金融、银行；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指数下跌79.73点。对IH指数周度跌幅提供负贡献排名前三的行业分别为：食品饮料、非银金融、银行；对IH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。中证500指数下跌23.65点。对IC指数周度跌幅提供负贡献排名前三的行业分别为：非银金融、传媒、建筑材料；对IC指数周度跌幅提供正贡献排名前三的行业分别为：电子、国防军工、医药生物。

北上资金净流出64.13亿元，统计每日北上资金前十大活跃股个股成交情况，周内合计净流出55.07亿元。在每日前十大活跃股中，沪深300指数300只成分股中有31只股票有北上资金参与，周内北上资金净买入12.39亿元，其中买入425.83亿元，卖出413.44亿元；上证50指数50只成分股中有15只股票有北上资金参与，周内净买入16.73亿元，其中买入197.14亿元，卖出180.41亿元；中证500指数500只成分股中有1只股票有北上资金参与，周内净卖出1.69亿元，其中买入1.99亿元，卖出3.68亿元。

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

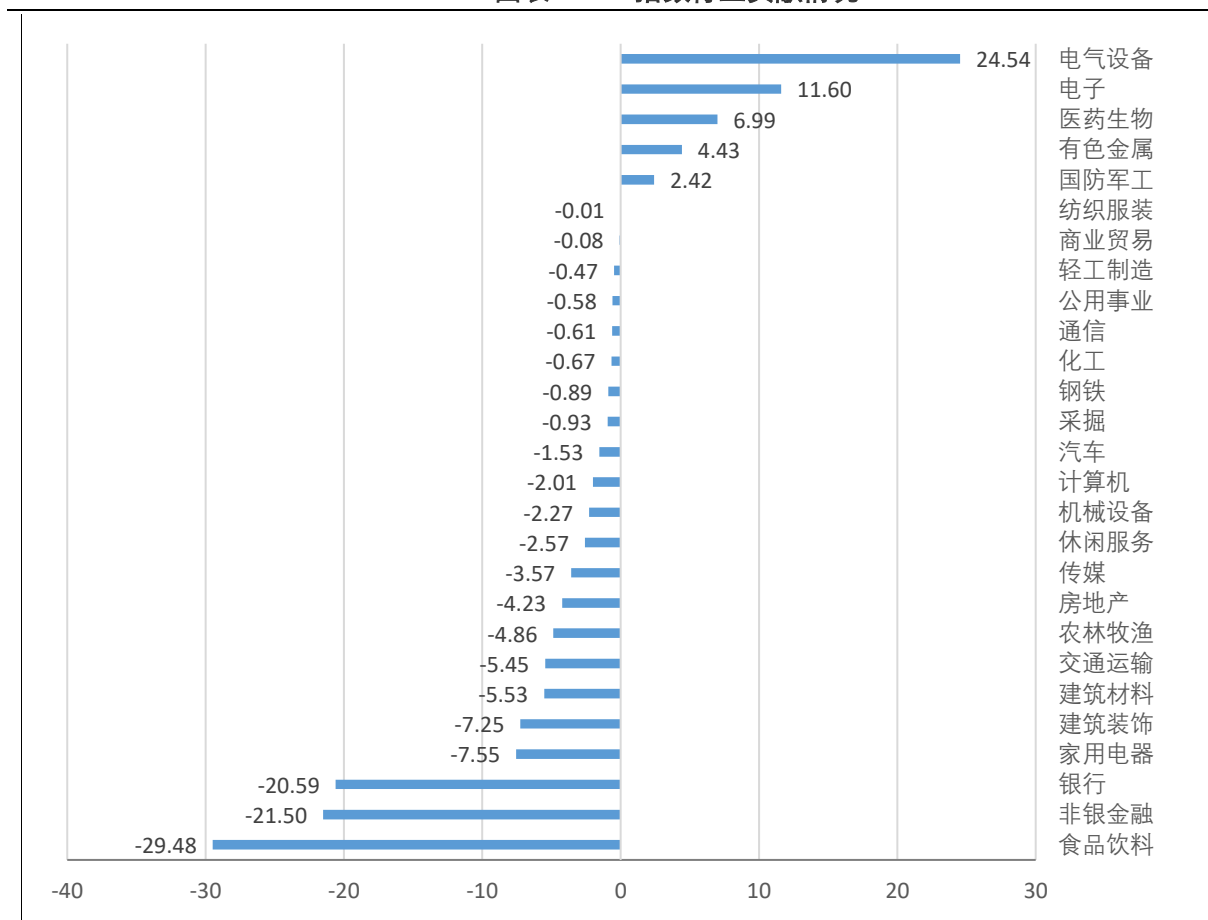
图表目录

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
图表 9: IC 北上资金流入情况.....	9

1. 成分股指数拉动情况

2022年2月21日至25日，沪深300指数下跌72.63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98只股票提供正贡献，有1只股票贡献为0。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：食品饮料、非银金融、银行；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：贵州茅台、中国平安、招商银行、美的集团、五粮液；对指数周度跌幅提供贡献点分别为：-16.74点，-7.21点，-5.94点，-5.65点，-4.26点。对IF指数周度跌幅提供正贡献排名前五的股票分别为：隆基股份、阳光电源、药明康德、天合光能、北方华创；对指数周度跌幅提供贡献点分别为：7.4点，3.42点，2.69点，2.63点，2.3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

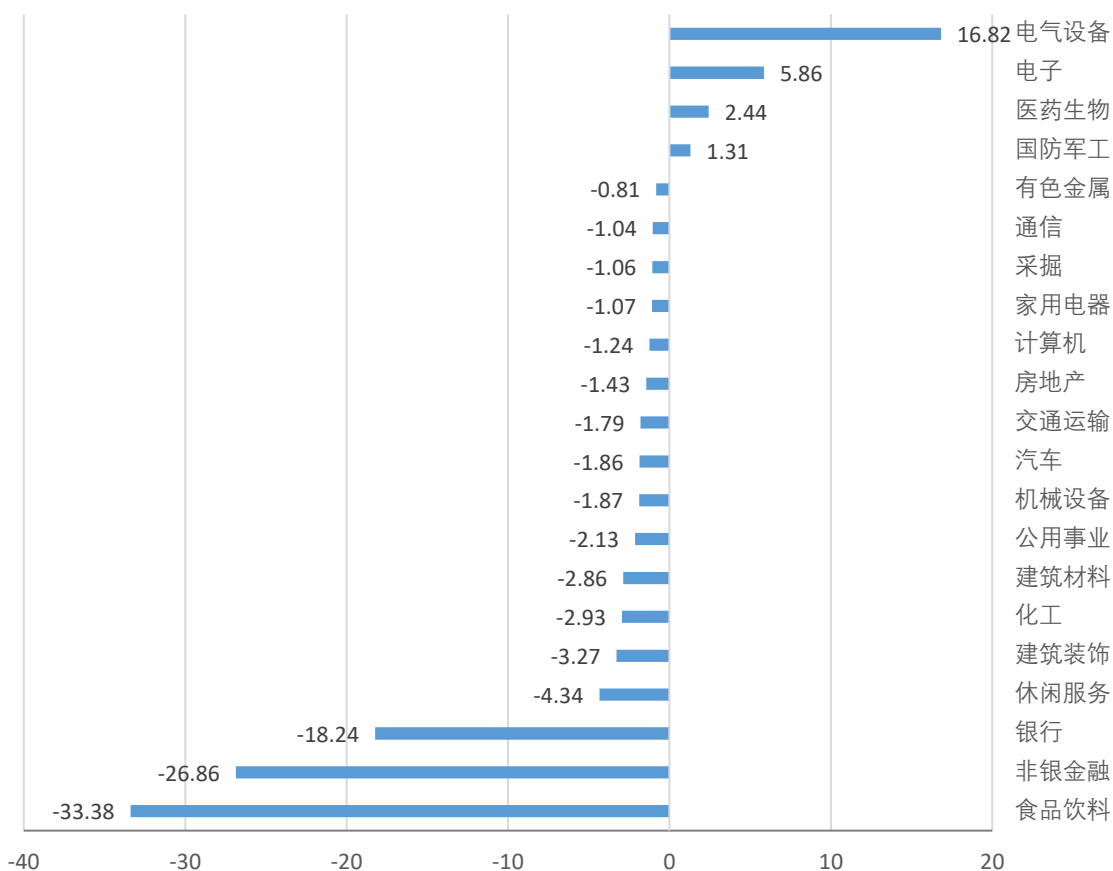
图表 2: IF 指数正/负贡献最大公司

	负贡献		正贡献	
	公司简称	点数	公司简称	点数
1	贵州茅台	-16.74	隆基股份	7.40
2	中国平安	-7.21	阳光电源	3.42
3	招商银行	-5.94	药明康德	2.69
4	美的集团	-5.65	天合光能	2.63
5	五粮液	-4.26	北方华创	2.30
6	中信证券	-2.77	海康威视	2.11
7	中国中免	-2.43	通威股份	2.05
8	泸州老窖	-2.37	中环股份	2.00
9	兴业银行	-2.18	长春高新	1.86
10	东方雨虹	-2.06	紫光国微	1.85

数据来源: wind, 兴证期货研发部

2022年2月21日至25日, 上证50指数下跌79.73点。在上证50指数的50只成分股中, 有41只股票对指数下跌提供负贡献, 有9只股票提供正贡献, 有0只股票贡献为0。分行业看, 对IH指数周度跌幅提供负贡献排名前三的行业分别为: 食品饮料、非银金融、银行; 对IH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IH指数周度跌幅提供负贡献排名前五的股票分别为: 贵州茅台、中国平安、招商银行、中信证券、中国中免; 对指数周度跌幅提供贡献点分别为: -29.09点, -12.4点, -10.4点, -4.81点, -4.34点。对IH指数周度跌幅提供正贡献排名前五的股票分别为: 隆基股份、药明康德、通威股份、闻泰科技、兆易创新; 对指数周度跌幅提供贡献点分别为: 13.06点, 5.09点, 3.76点, 2.26点, 2.24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

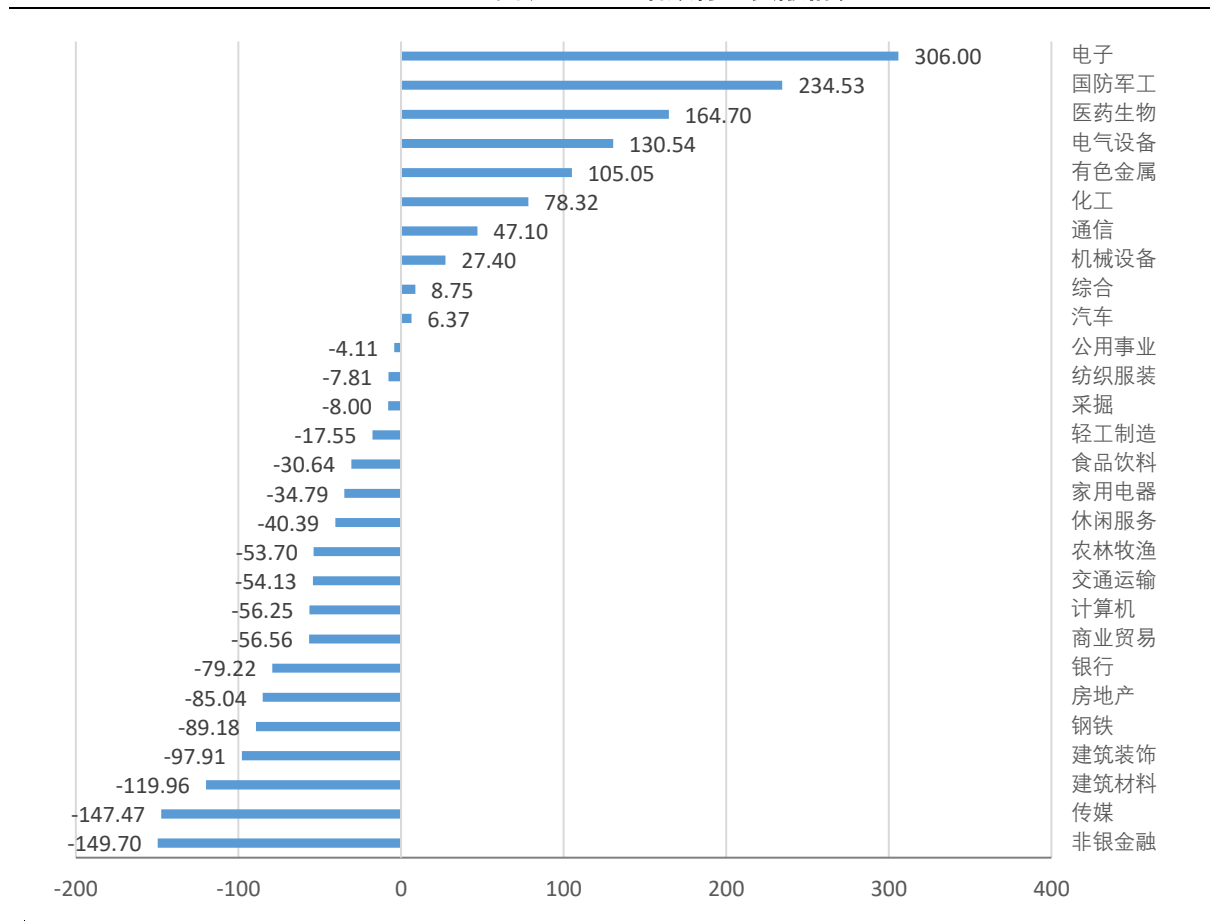
图表 4: IH 指数正/负贡献最大公司

	负贡献		正贡献	
	公司简称	点数	公司简称	点数
1	贵州茅台	-29.09	隆基股份	13.06
2	中国平安	-12.40	药明康德	5.09
3	招商银行	-10.40	通威股份	3.76
4	中信证券	-4.81	闻泰科技	2.26
5	中国中免	-4.34	兆易创新	2.24
6	兴业银行	-3.77	韦尔股份	1.52
7	中国建筑	-3.27	航发动力	1.31
8	海螺水泥	-2.86	山东黄金	0.58
9	万华化学	-2.52	中国石油	0.34
10	华泰证券	-2.22	工业富联	-0.15

数据来源: wind, 兴证期货研发部

2022年2月21日至25日，中证500指数下跌23.65点。在中证500指数的500只成分股中，有310只股票对指数下跌提供负贡献，有187只股票提供正贡献，有3只股票贡献为0。分行业看，对IC指数周度跌幅提供负贡献排名前三的行业分别为：非银金融、传媒、建筑材料；对IC指数周度跌幅提供正贡献排名前三的行业分别为：电子、国防军工、医药生物。分个股看，对IC指数周度跌幅提供负贡献排名前五的股票分别为：国瓷材料、巨星科技、东山精密、旗滨集团、中国化学；对指数周度跌幅提供贡献点分别为：-53.96点，-48.53点，-34.99点，-33.16点，-32.13点。对IC指数周度跌幅提供正贡献排名前五的股票分别为：杉杉股份、迈为股份、九洲药业、卫士通、兴发集团；对指数周度跌幅提供贡献点分别为：71.77点，68.66点，67.59点，61.68点，61.32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	国瓷材料	-53.96	杉杉股份	71.77
2	巨星科技	-48.53	迈为股份	68.66
3	东山精密	-34.99	九洲药业	67.59
4	旗滨集团	-33.16	卫士通	61.68
5	中国化学	-32.13	兴发集团	61.32
6	上海建工	-30.72	中兵红箭	47.71
7	金证股份	-26.58	捷佳伟创	46.66
8	锦江酒店	-25.52	法拉电子	46.42
9	捷成股份	-23.38	中航重机	46.08
10	利亚德	-23.28	斯达半导	41.88

数据来源: wind, 兴证期货研发部

2. 北上资金个股流向

2022年2月21日至25日当周,北上资金净流出64.13亿元,统计每日北上资金前十大活跃股个股成交情况,周内合计净流出55.07亿元。在每日前十大活跃股中,沪深300指数300只成分股中有31只股票有北上资金参与,周内北上资金净买入12.39亿元,其中买入425.83亿元,卖出413.44亿元;上证50指数50只成分股中有15只股票有北上资金参与,周内净买入16.73亿元,其中买入197.14亿元,卖出180.41亿元;中证500指数500只成分股中有1只股票有北上资金参与,周内净卖出1.69亿元,其中买入1.99亿元,卖出3.68亿元。

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	5.84	2.19	29.54	35.38	-5.85
300750.SZ	宁德时代	3.60	0.11	51.02	49.06	1.96
600036.SH	招商银行	2.71	1.13	21.99	16.78	5.22
601318.SH	中国平安	2.50	0.34	20.20	26.93	-6.73
000858.SZ	五粮液	1.97	1.78	19.93	17.00	2.92
601012.SH	隆基股份	1.66	-2.24	23.76	18.10	5.66
300059.SZ	东方财富	1.34	-0.93	31.69	30.69	1.00
601166.SH	兴业银行	1.26	-0.95	19.13	14.36	4.78
600900.SH	长江电力	1.18	-0.24	2.75	2.56	0.19
002475.SZ	立讯精密	1.14	-2.00	20.44	23.26	-2.82
002594.SZ	比亚迪	1.11	-0.14	18.78	9.94	8.84
600030.SH	中信证券	1.02	0.00	2.27	3.20	-0.92
603259.SH	药明康德	1.01	-1.44	24.11	19.93	4.18
601888.SH	中国中免	0.95	1.58	15.26	8.26	7.00
600887.SH	伊利股份	0.94	0.00	3.07	1.27	1.80
000651.SZ	格力电器	0.81	-0.87	4.23	4.48	-0.25
300760.SZ	迈瑞医疗	0.75	-1.29	10.07	21.10	-11.03
603501.SH	韦尔股份	0.73	-0.96	9.94	11.86	-1.92
600809.SH	山西汾酒	0.69	0.27	2.55	3.32	-0.77
601899.SH	紫金矿业	0.64	0.45	17.35	12.44	4.91
300274.SZ	阳光电源	0.64	0.63	17.19	12.00	5.19
000002.SZ	万科A	0.63	-0.64	3.12	1.40	1.72
002812.SZ	恩捷股份	0.62	-0.35	4.94	10.23	-5.30
002241.SZ	歌尔股份	0.62	-0.92	9.85	10.05	-0.20
300124.SZ	汇川技术	0.58	-0.19	4.89	1.84	3.05
300014.SZ	亿纬锂能	0.57	0.46	12.74	19.11	-6.37
600048.SH	保利发展	0.51	-0.03	3.68	1.36	2.32
002460.SZ	赣锋锂业	0.49	0.22	16.42	15.64	0.78
601668.SH	中国建筑	0.48	-0.30	1.53	4.67	-3.13
603799.SH	华友钴业	0.47	-0.10	3.11	2.72	0.39
603260.SH	合盛硅业	0.09	-0.10	0.28	4.52	-4.24

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	16.08	4.07	29.54	35.38	-5.85
600036.SH	招商银行	7.53	2.12	21.99	16.78	5.22
601318.SH	中国平安	6.82	0.62	20.20	26.93	-6.73
601012.SH	隆基股份	4.66	-4.22	23.76	18.10	5.66
601166.SH	兴业银行	3.46	-1.76	19.13	14.36	4.78
600900.SH	长江电力	3.22	-0.45	2.75	2.56	0.19
603259.SH	药明康德	3.04	-2.91	24.11	19.93	4.18
600030.SH	中信证券	2.81	0.00	2.27	3.20	-0.92
601888.SH	中国中免	2.68	3.01	15.26	8.26	7.00
600887.SH	伊利股份	2.65	0.00	3.07	1.27	1.80
603501.SH	韦尔股份	2.02	-1.78	9.94	11.86	-1.92
600809.SH	山西汾酒	1.93	0.50	2.55	3.32	-0.77
601899.SH	紫金矿业	1.75	0.83	17.35	12.44	4.91
600048.SH	保利发展	1.40	-0.06	3.68	1.36	2.32
601668.SH	中国建筑	1.31	-0.55	1.53	4.67	-3.13

数据来源: wind, 兴证期货研发部

图表 9: IC 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
600141.SH	兴发集团	0.42	-0.31	1.99	3.68	-1.69

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。