

成分股监测报告

2022年3月23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

邮箱：

yangna@xzfutures.com

内容提要

● 我们的观点

2022年3月14日至3月18日，沪深300指数上涨17.75点。对IF指数周度涨幅提供负贡献排名前三的行业分别为：非银金融、医药生物、房地产；对IF指数周度涨幅提供正贡献排名前三的行业分别为：食品饮料、电子、公用事业。上证50指数上涨23.35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、银行、非银金融；对IH指数周度涨幅提供正贡献排名前三的行业分别为：食品饮料、休闲服务、公用事业。中证500指数下跌87.02点。对IC指数周度跌幅提供负贡献排名前三的行业分别为：有色金属、公用事业、化工；对IC指数周度跌幅提供正贡献排名前三的行业分别为：非银金融、房地产、休闲服务。

北上资金净流出166.92亿元，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129.49亿元。在每日前十大活跃股中，沪深300指数300只成分股中有38只股票有北上资金参与，周内北上资金净卖出128.05亿元，其中买入710.01亿元，卖出838.06亿元；上证50指数50只成分股中有17只股票有北上资金参与，周内净卖出72.4亿元，其中买入365.83亿元，卖出438.23亿元；中证500指数500只成分股无北上资金参与。

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

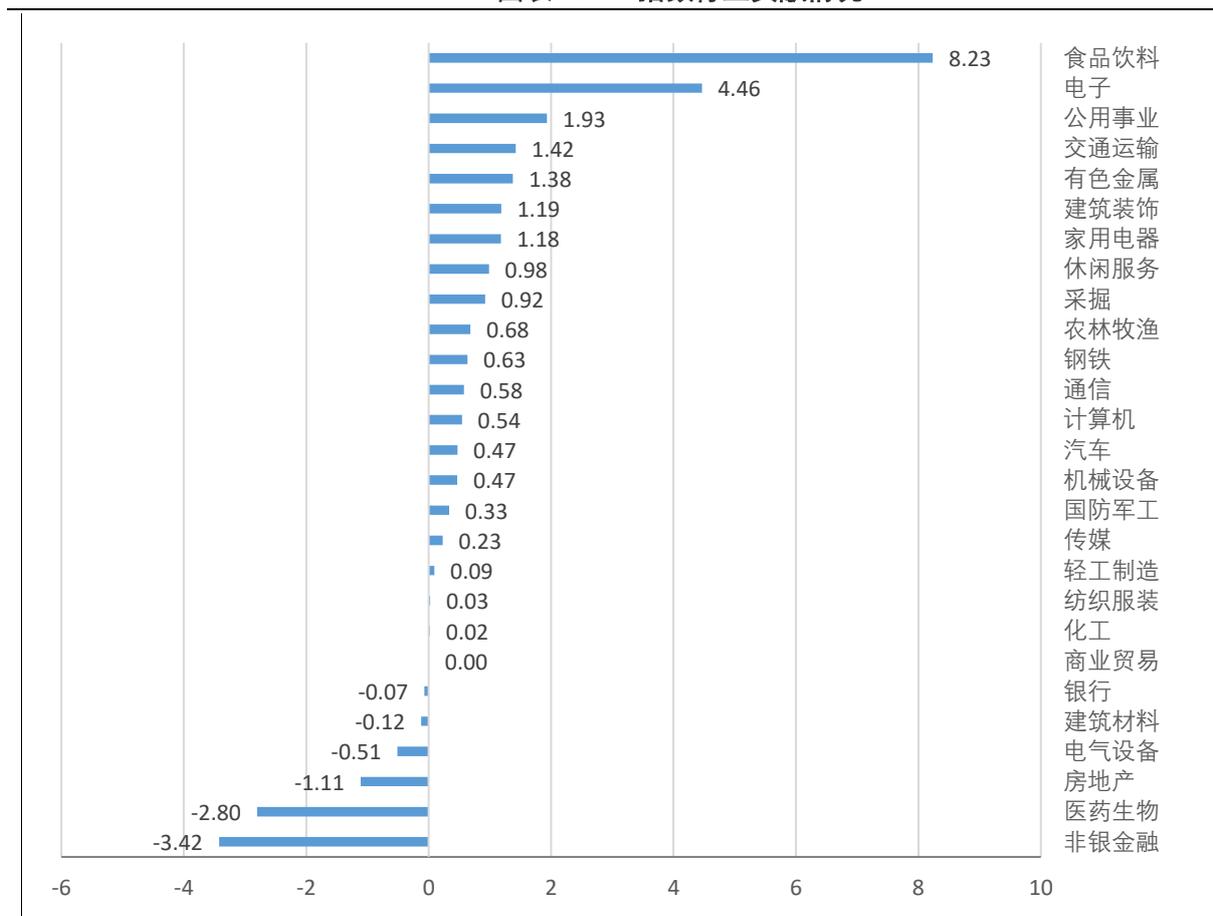
图表目录

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

2022年3月14日至3月18日，沪深300指数上涨17.75点。在沪深300指数的300只成分股中，有90只股票对指数上涨提供负贡献，有206只股票提供正贡献，有4只股票贡献为0。分行业看，对IF指数周度涨幅提供负贡献排名前三的行业分别为：非银金融、医药生物、房地产；对IF指数周度涨幅提供正贡献排名前三的行业分别为：食品饮料、电子、公用事业。分个股看，对IF指数周度涨幅提供负贡献排名前五的股票分别为：宁德时代、沃森生物、招商银行、东方财富、智飞生物；对指数周度涨幅提供贡献点分别为：-2.44点，-2.38点，-2.07点，-1.49点，-1.25点。对IF指数周度涨幅提供正贡献排名前五的股票分别为：贵州茅台、爱尔眼科、国电南瑞、中国中免、顺丰控股；对指数周度涨幅提供贡献点分别为：3.98点，1.22点，1.21点，1.01点，0.98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

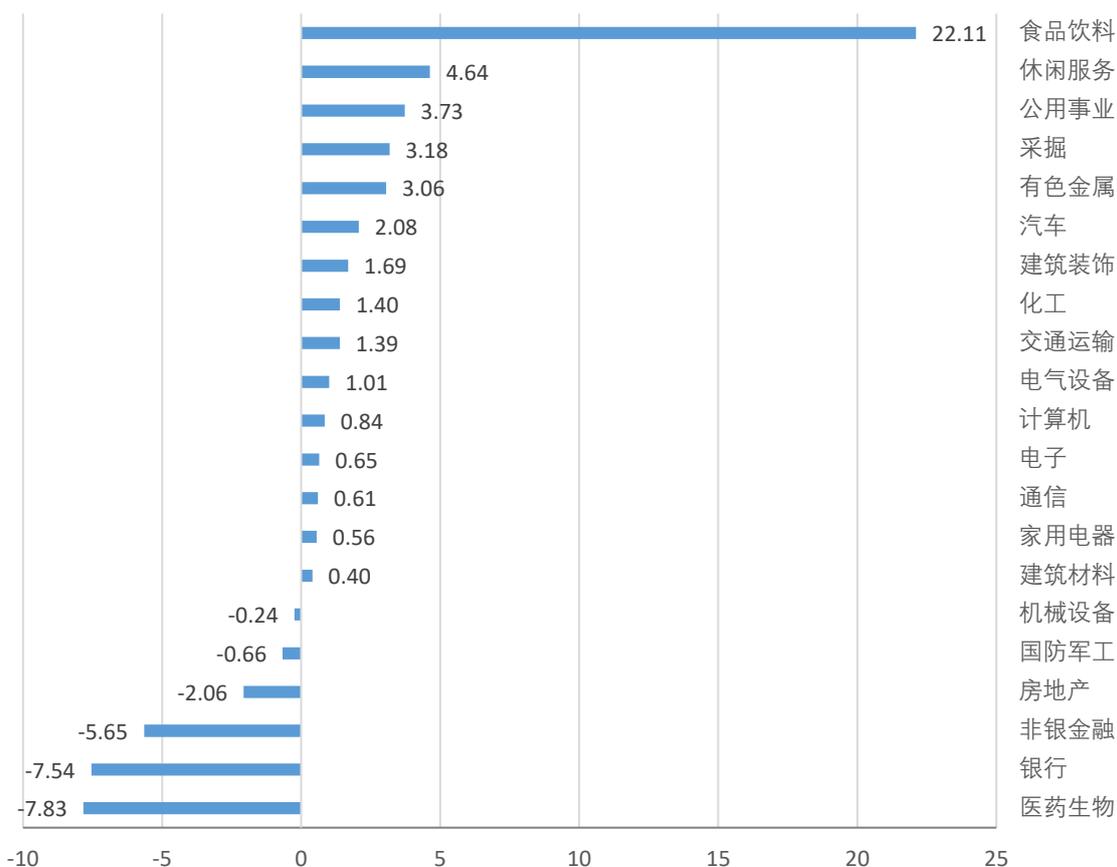
图表 2: IF 指数正/负贡献最大公司

	负贡献		正贡献	
	公司简称	点数	公司简称	点数
1	宁德时代	-2.44	贵州茅台	3.98
2	沃森生物	-2.38	爱尔眼科	1.22
3	招商银行	-2.07	国电南瑞	1.21
4	东方财富	-1.49	中国中免	1.01
5	智飞生物	-1.25	顺丰控股	0.98
6	亿纬锂能	-1.24	海康威视	0.92
7	药明康德	-0.99	五粮液	0.87
8	复星医药	-0.93	长江电力	0.84
9	中国平安	-0.83	洋河股份	0.75
10	万科A	-0.60	长春高新	0.75

数据来源: wind, 兴证期货研发部

2022年3月14日至3月18日, 上证50指数上涨23.35点。在上证50指数的50只成分股中, 有16只股票对指数上涨提供负贡献, 有34只股票提供正贡献, 有0只股票贡献为0。分行业看, 对IH指数周度涨幅提供负贡献排名前三的行业分别为: 医药生物、银行、非银金融; 对IH指数周度涨幅提供正贡献排名前三的行业分别为: 食品饮料、休闲服务、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: 招商银行、药明康德、复星医药、中国平安、中信证券; 对指数周度涨幅提供贡献点分别为: -9.28点, -4.81点, -4.21点, -3.64点, -2.36点。对IH指数周度涨幅提供正贡献排名前五的股票分别为: 贵州茅台、中国中免、长江电力、山西汾酒、中国神华; 对指数周度涨幅提供贡献点分别为: 17.73点, 4.64点, 3.73点, 2.73点, 2.06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

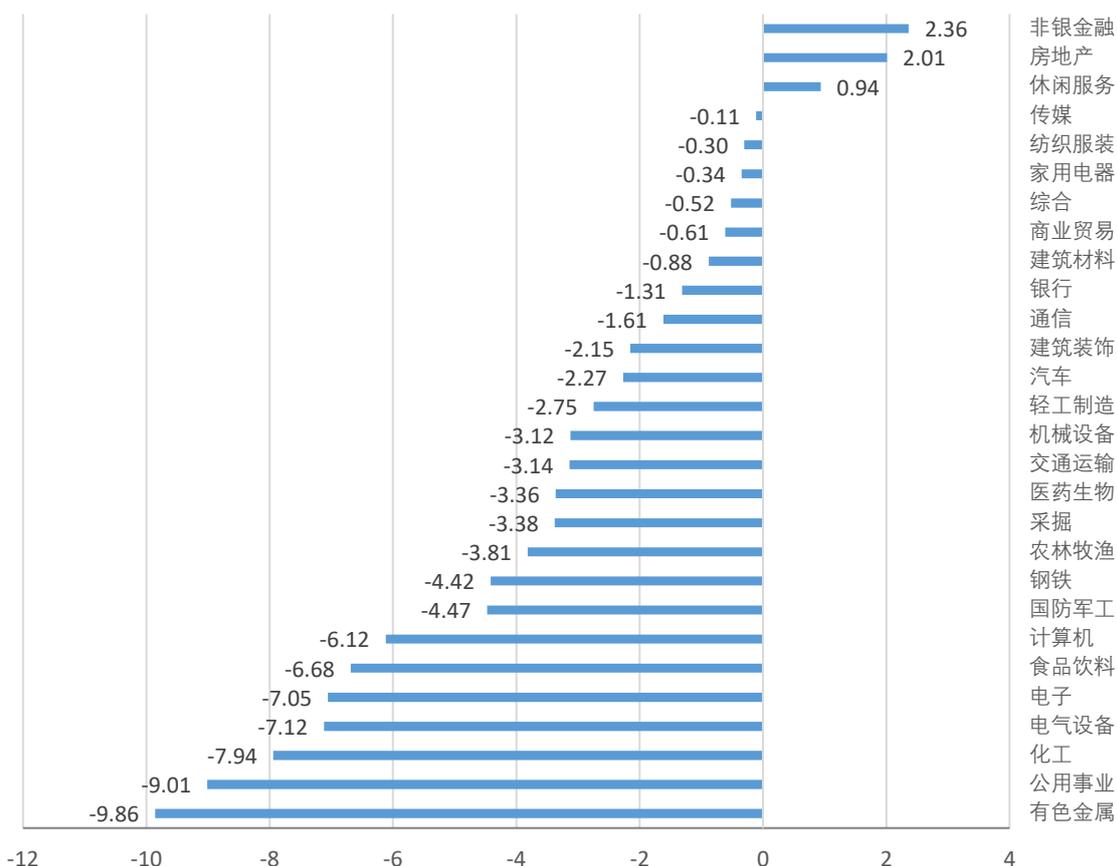
图表 4: IH 指数正/负贡献最大公司

	负贡献		正贡献	
	公司简称	点数	公司简称	点数
1	招商银行	-9.28	贵州茅台	17.73
2	药明康德	-4.81	中国中免	4.64
3	复星医药	-4.21	长江电力	3.73
4	中国平安	-3.64	山西汾酒	2.73
5	中信证券	-2.36	中国神华	2.06
6	保利发展	-2.06	闻泰科技	2.02
7	兆易创新	-0.88	紫金矿业	1.77
8	航发动力	-0.66	中国建筑	1.69
9	韦尔股份	-0.63	中远海控	1.39
10	华泰证券	-0.42	通威股份	1.33

数据来源: wind, 兴证期货研发部

2022年3月14日至3月18日，中证500指数下跌87.02点。在中证500指数的500只成分股中，有390只股票对指数下跌提供负贡献，有102只股票提供正贡献，有8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：有色金属、公用事业、化工；对IC指数周度跌幅提供正贡献排名前三的行业分别为：非银金融、房地产、休闲服务。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：口子窖、九洲药业、格林美、鱼跃医疗、光威复材；对指数周度跌幅提供贡献点分别为：-2.92点，-1.48点，-1.4点，-1.39点，-1.38点。对IC指数周度跌幅提供正贡献排名前五的股票分别为：容百科技、中国医药、红日药业、以岭药业、蓝色光标；对指数周度跌幅提供贡献点分别为：2.16点，2.09点，1.98点，1.29点，1.14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	口子窖	-2.92	容百科技	2.16
2	九洲药业	-1.48	中国医药	2.09
3	格林美	-1.40	红日药业	1.98
4	鱼跃医疗	-1.39	以岭药业	1.29
5	光威复材	-1.38	蓝色光标	1.14
6	大北农	-1.23	国盛金控	0.93
7	云铝股份	-1.13	华创阳安	0.90
8	中航高科	-1.13	法拉电子	0.87
9	明阳智能	-1.11	拓普集团	0.84
10	思源电气	-1.09	抚顺特钢	0.80

数据来源: wind, 兴证期货研发部

2. 北上资金个股流向

2022年3月14日至3月18日,北上资金净流出166.92亿元,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129.49亿元。在每日前十大活跃股中,沪深300指数300只成分股中有38只股票有北上资金参与,周内北上资金净卖出128.05亿元,其中买入710.01亿元,卖出838.06亿元;上证50指数50只成分股中有17只股票有北上资金参与,周内净卖出72.4亿元,其中买入365.83亿元,卖出438.23亿元;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	83.78	136.41	-52.63
300750.SZ	宁德时代	3.6037	0.11	77.54	92.26	-14.73
600036.SH	招商银行	2.7107	1.13	61.79	47.65	14.14
601318.SH	中国平安	2.5024	0.34	33.14	35.13	-1.98
000858.SZ	五粮液	1.9653	1.78	29.21	40.39	-11.18
000333.SZ	美的集团	1.6687	-1.23	34.16	11.72	22.45
601012.SH	隆基股份	1.6645	-2.24	33.88	36.06	-2.18
300059.SZ	东方财富	1.3431	-0.93	59.45	69.99	-10.55
601166.SH	兴业银行	1.2601	-0.95	8.13	6.30	1.83
600900.SH	长江电力	1.1764	-0.24	18.03	17.31	0.72
002475.SZ	立讯精密	1.1398	-2	15.74	13.61	2.13
002594.SZ	比亚迪	1.1128	-0.14	15.23	15.33	-0.10
600276.SH	恒瑞医药	1.0219	-0.8	3.72	6.29	-2.57
600030.SH	中信证券	1.0202	0	15.23	11.29	3.94
603259.SH	药明康德	1.0107	-1.44	32.07	37.08	-5.02
601888.SH	中国中免	0.9466	1.58	13.46	19.27	-5.81
600887.SH	伊利股份	0.9439	0	11.72	22.09	-10.37
000568.SZ	泸州老窖	0.8315	0.11	2.72	4.05	-1.33
000651.SZ	格力电器	0.8054	-0.87	3.17	5.99	-2.81
300760.SZ	迈瑞医疗	0.753	-1.29	17.35	19.82	-2.47
603501.SH	韦尔股份	0.7332	-0.96	16.45	18.57	-2.12
600309.SH	万华化学	0.7114	-0.59	3.57	11.59	-8.03
002714.SZ	牧原股份	0.6889	-1.27	4.98	2.89	2.09
002142.SZ	宁波银行	0.6771	-0.5	5.92	7.54	-1.62
601899.SH	紫金矿业	0.6412	0.45	5.46	10.51	-5.05
300274.SZ	阳光电源	0.6376	0.63	3.36	7.53	-4.17
002352.SZ	顺丰控股	0.6349	-0.04	9.10	9.44	-0.34
002812.SZ	恩捷股份	0.6173	-0.35	13.58	32.66	-19.08
002241.SZ	歌尔股份	0.617	-0.92	3.88	5.64	-1.76
600031.SH	三一重工	0.6139	-1.29	6.88	1.83	5.05
603288.SH	海天味业	0.607	0.51	12.66	12.35	0.31
300014.SZ	亿纬锂能	0.5725	0.46	8.67	10.48	-1.81
300015.SZ	爱尔眼科	0.5168	-0.59	15.81	20.78	-4.97
002460.SZ	赣锋锂业	0.4928	0.22	10.42	16.18	-5.76
600406.SH	国电南瑞	0.4862	-0.82	5.43	5.11	0.32
601668.SH	中国建筑	0.4779	-0.3	5.87	8.48	-2.61
300122.SZ	智飞生物	0.4396	-0.6	5.17	4.12	1.05
002027.SZ	分众传媒	0.3892	-0.25	3.29	4.31	-1.02

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	83.78	136.41	-52.63
600036.SH	招商银行	7.529	2.12	61.79	47.65	14.14
601318.SH	中国平安	6.819	0.62	33.14	35.13	-1.98
601012.SH	隆基股份	4.661	-4.22	33.88	36.06	-2.18
601166.SH	兴业银行	3.458	-1.76	8.13	6.30	1.83
600900.SH	长江电力	3.223	-0.45	18.03	17.31	0.72
603259.SH	药明康德	3.037	-2.91	32.07	37.08	-5.02
600276.SH	恒瑞医药	2.835	-1.5	3.72	6.29	-2.57
600030.SH	中信证券	2.809	0	15.23	11.29	3.94
601888.SH	中国中免	2.675	3.01	13.46	19.27	-5.81
600887.SH	伊利股份	2.651	0	11.72	22.09	-10.37
603501.SH	韦尔股份	2.024	-1.78	16.45	18.57	-2.12
600309.SH	万华化学	1.98	-1.1	3.57	11.59	-8.03
601899.SH	紫金矿业	1.746	0.83	5.46	10.51	-5.05
600031.SH	三一重工	1.69	-2.40	6.88	1.83	5.05
603288.SH	海天味业	1.66	0.94	12.66	12.35	0.31
601668.SH	中国建筑	1.31	-0.55	5.87	8.48	-2.61

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。本报告清晰准确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。