

成分股监测报告

2022年3月30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21日至3月25日，沪深300指数下跌105.57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、电气设备、电子；对IF指数周度跌幅提供正贡献排名前三的行业分别为：有色金属、采掘、农林牧渔。上证50指数下跌62.83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、电气设备、非银金融；对IH指数周度跌幅提供正贡献排名前三的行业分别为：有色金属、采掘、医药生物。中证500指数下跌72.32点。对IC指数周度跌幅提供负贡献排名前三的行业分别为：电子、电气设备、计算机；对IC指数周度跌幅提供正贡献排名前三的行业分别为：房地产、采掘、农林牧渔。

周内合计净流出127.79亿元。在每日前十大活跃股中，沪深300指数300只成分股中有37只股票有北上资金参与，周内北上资金净卖出24.86亿元，其中买入359.37亿元，卖出384.23亿元；上证50指数50只成分股中有18只股票有北上资金参与，周内净卖出17.14亿元，其中买入186.89亿元，卖出204.03亿元；中证500指数500只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

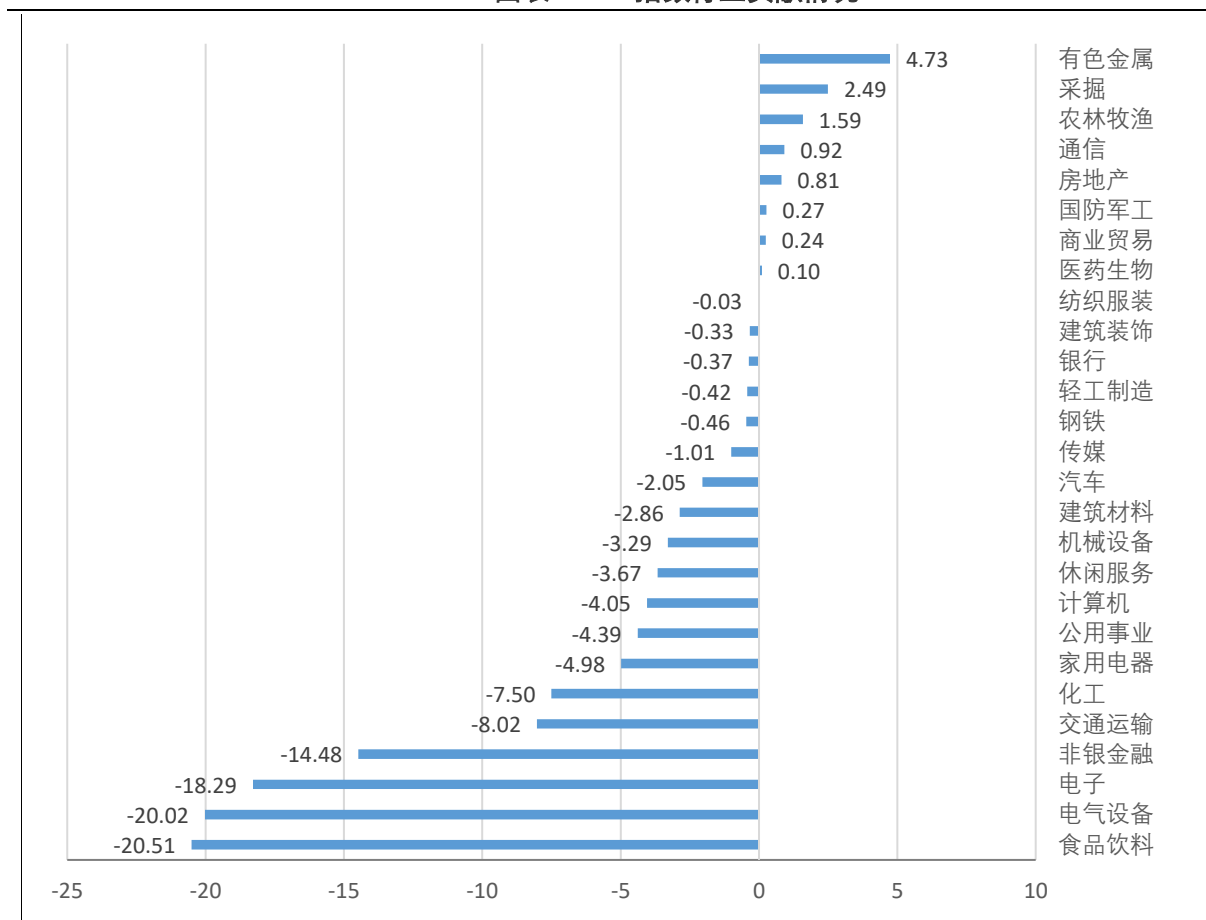
图表目录

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

2022年3月21日至3月25日，沪深300指数下跌105.57点。在沪深300指数的300只成分股中，有220只股票对指数下跌提供负贡献，有78只股票提供正贡献，有2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、电气设备、电子；对IF指数周度跌幅提供正贡献排名前三的行业分别为：有色金属、采掘、农林牧渔。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：五粮液、隆基股份、美的集团、中国中免、东方财富；对指数周度跌幅提供贡献点分别为：-5.97点，-4.7点，-3.79点，-3.48点，-3.42点。对IF指数周度跌幅提供正贡献排名前五的股票分别为：药明康德、紫金矿业、宁波银行、中国神华、中兴通讯；对指数周度跌幅提供贡献点分别为：2.9点，2.56点，1.52点，1.39点，1.3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

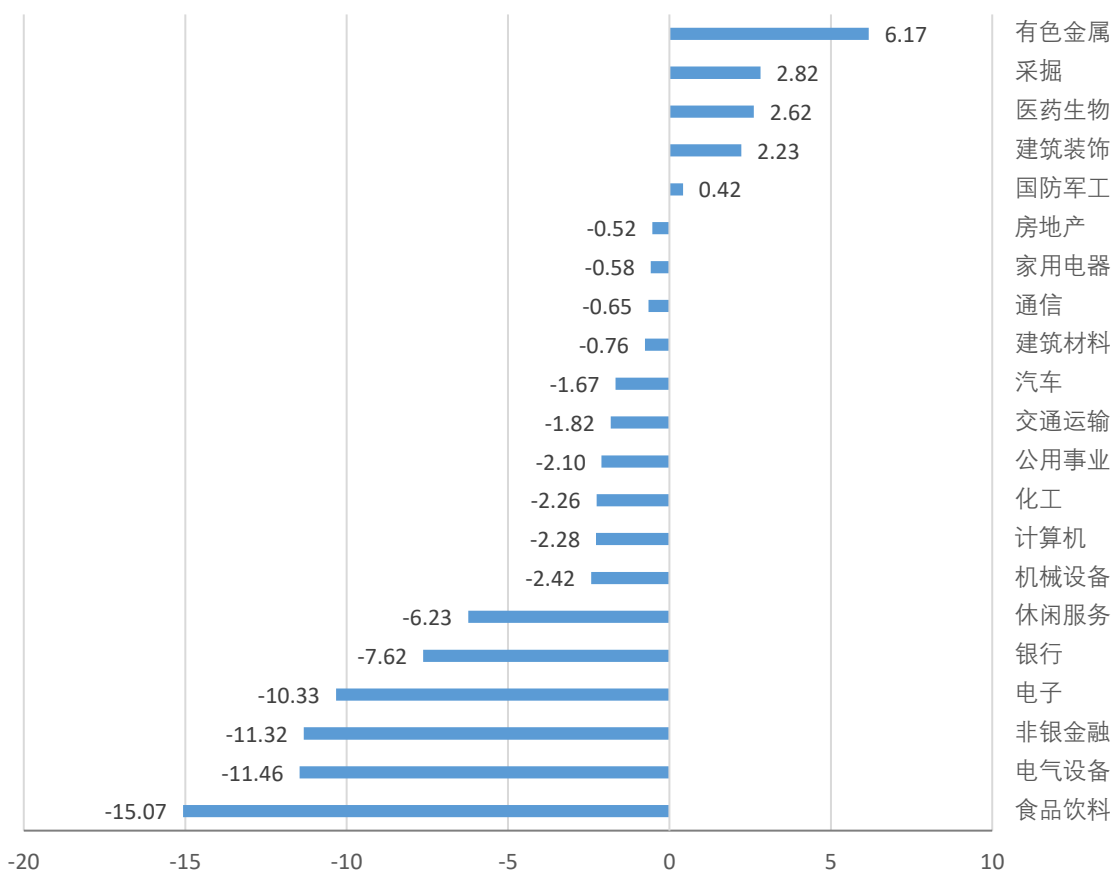
图表 2: IF 指数正/负贡献最大公司

	负贡献		正贡献	
	公司简称	点数	公司简称	点数
1	五粮液	-5.97	药明康德	2.90
2	隆基股份	-4.70	紫金矿业	2.56
3	美的集团	-3.79	宁波银行	1.52
4	中国中免	-3.48	中国神华	1.39
5	东方财富	-3.42	中兴通讯	1.30
6	阳光电源	-3.10	中国建筑	1.28
7	韦尔股份	-2.97	山东黄金	1.01
8	贵州茅台	-2.90	爱尔眼科	0.90
9	宁德时代	-2.83	温氏股份	0.87
10	海康威视	-2.81	天齐锂业	0.80

数据来源: wind, 兴证期货研发部

2022年3月21日至3月25日, 上证50指数下跌62.83点。在上证50指数的50只成分股中, 有38只股票对指数下跌提供负贡献, 有12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、电气设备、非银金融; 对IH指数周度跌幅提供正贡献排名前三的行业分别为: 有色金属、采掘、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: 隆基股份、中国中免、韦尔股份、贵州茅台、招商银行; 对指数周度跌幅提供贡献点分别为: -8.34点, -6.23点, -5.2点, -5.06点, -4.88点。对IH指数周度跌幅提供正贡献排名前五的股票分别为: 药明康德、紫金矿业、中国神华、中国建筑、山东黄金; 对指数周度跌幅提供贡献点分别为: 5.53点, 4.42点, 2.41点, 2.23点, 1.75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

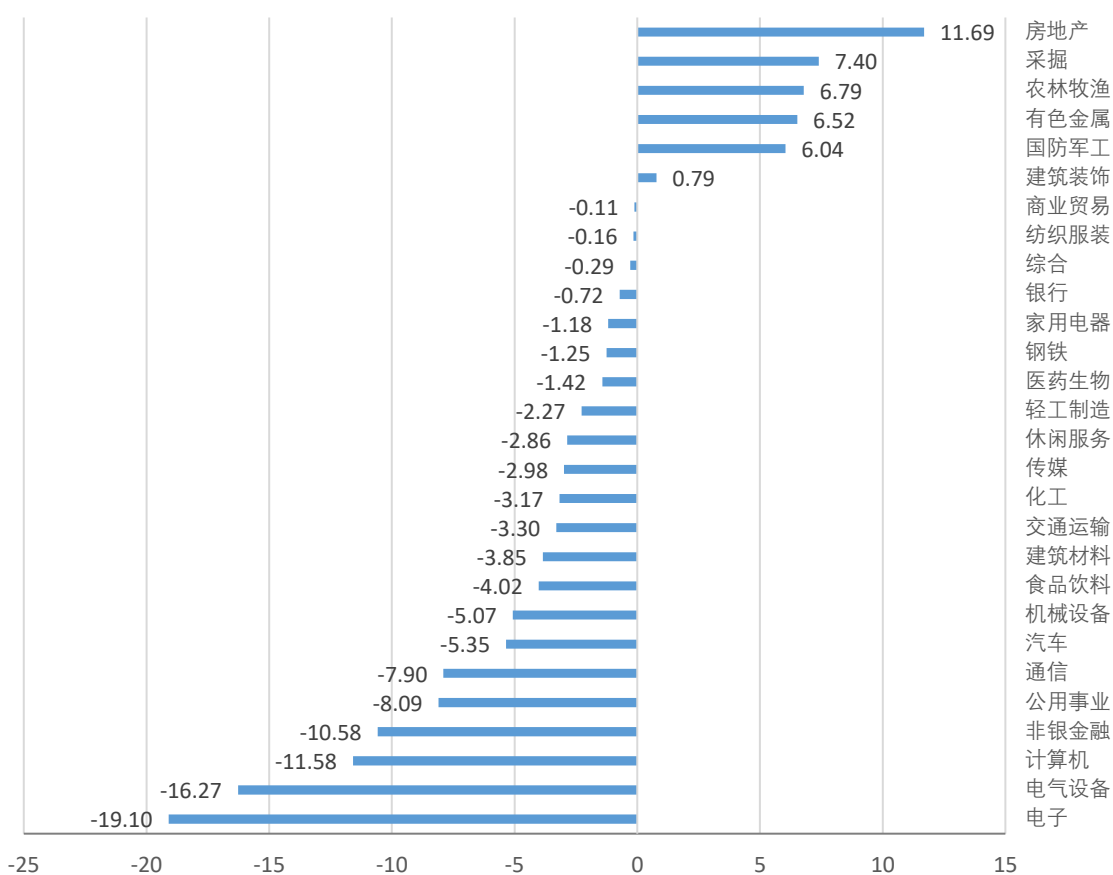
图表 4: IH 指数正/负贡献最大公司

	负贡献		正贡献	
	公司简称	点数	公司简称	点数
1	隆基股份	-8.34	药明康德	5.53
2	中国中免	-6.23	紫金矿业	4.42
3	韦尔股份	-5.20	中国神华	2.41
4	贵州茅台	-5.06	中国建筑	2.23
5	招商银行	-4.88	山东黄金	1.75
6	伊利股份	-4.34	工商银行	0.94
7	中信证券	-4.27	航发动力	0.42
8	山西汾酒	-3.51	中国石油	0.41
9	兴业银行	-3.47	农业银行	0.26
10	闻泰科技	-3.30	中国石化	0.16

数据来源: wind, 兴证期货研发部

2022年3月21日至3月25日，中证500指数下跌72.32点。在中证500指数的500只成分股中，有337只股票对指数下跌提供负贡献，有159只股票提供正贡献，有4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：电子、电气设备、计算机；对IC指数周度跌幅提供正贡献排名前三的行业分别为：房地产、采掘、农林牧渔。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：迈为股份、明阳智能、中天科技、法拉电子、宏发股份；对指数周度跌幅提供贡献点分别为：-3.87点，-3.64点，-3.43点，-3.21点，-3.19点。对IC指数周度跌幅提供正贡献排名前五的股票分别为：广汇能源、阳光城、中航机电、银泰黄金、兖矿能源；对指数周度跌幅提供贡献点分别为：3.62点，3.47点，2.83点，2.72点，2.61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	迈为股份	-3.87	广汇能源	3.62
2	明阳智能	-3.64	阳光城	3.47
3	中天科技	-3.43	中航机电	2.83
4	法拉电子	-3.21	银泰黄金	2.72
5	宏发股份	-3.19	兖矿能源	2.61
6	容百科技	-2.66	山西焦煤	2.52
7	立昂微	-2.65	海格通信	2.20
8	晶晨股份	-2.41	赤峰黄金	2.13
9	日月股份	-2.37	巨星科技	2.13
10	瑞芯微	-2.34	国药股份	1.96

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21日至3月25日, 北上资金净流出127.79亿元, 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25.22亿元。在每日前十大活跃股中, 沪深300指数300只成分股中有37只股票有北上资金参与, 周内北上资金净卖出24.86亿元, 其中买入359.37亿元, 卖出384.23亿元; 上证50指数50只成分股中有18只股票有北上资金参与, 周内净卖出17.14亿元, 其中买入186.89亿元, 卖出204.03亿元; 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	32.28	56.84	-24.56
300750.SZ	宁德时代	3.6037	0.11	38.93	36.65	2.28
600036.SH	招商银行	2.7107	1.13	27.65	18.79	8.86
601318.SH	中国平安	2.5024	0.34	10.39	17.49	-7.11
000858.SZ	五粮液	1.9653	1.78	15.69	24.34	-8.65
000333.SZ	美的集团	1.6687	-1.23	3.87	1.80	2.08
601012.SH	隆基股份	1.6645	-2.24	19.15	19.69	-0.54
300059.SZ	东方财富	1.3431	-0.93	16.55	22.29	-5.75
601166.SH	兴业银行	1.2601	-0.95	17.51	14.78	2.73
600900.SH	长江电力	1.1764	-0.24	1.07	3.91	-2.83
002475.SZ	立讯精密	1.1398	-2	1.90	4.19	-2.29
002594.SZ	比亚迪	1.1128	-0.14	17.51	17.16	0.35
600276.SH	恒瑞医药	1.0219	-0.8	1.62	3.11	-1.49
600030.SH	中信证券	1.0202	0	2.11	3.45	-1.35
603259.SH	药明康德	1.0107	-1.44	28.51	22.95	5.56
601888.SH	中国中免	0.9466	1.58	1.95	1.89	0.06
600887.SH	伊利股份	0.9439	0	5.31	6.72	-1.40
000651.SZ	格力电器	0.8054	-0.87	1.58	3.55	-1.98
300760.SZ	迈瑞医疗	0.753	-1.29	7.91	7.08	0.83
603501.SH	韦尔股份	0.7332	-0.96	6.39	8.99	-2.60
600309.SH	万华化学	0.7114	-0.59	3.18	2.79	0.38
600809.SH	山西汾酒	0.6864	0.27	4.05	6.12	-2.07
601899.SH	紫金矿业	0.6412	0.45	13.23	5.63	7.60
300274.SZ	阳光电源	0.6376	0.63	7.66	2.66	5.00
002352.SZ	顺丰控股	0.6349	-0.04	6.00	4.82	1.18
000002.SZ	万科A	0.6318	-0.64	5.87	9.61	-3.75
002812.SZ	恩捷股份	0.6173	-0.35	8.14	6.95	1.19
300014.SZ	亿纬锂能	0.5725	0.46	7.95	6.84	1.11
300015.SZ	爱尔眼科	0.5168	-0.59	1.86	2.94	-1.08
600048.SH	保利发展	0.514	-0.03	3.04	2.44	0.60
002460.SZ	赣锋锂业	0.4928	0.22	12.87	13.71	-0.84
600406.SH	国电南瑞	0.4862	-0.82	4.70	1.84	2.86
000063.SZ	中兴通讯	0.4812	-0.72	1.55	4.77	-3.21
601668.SH	中国建筑	0.4779	-0.3	6.47	6.51	-0.04
300347.SZ	泰格医药	0.2816	-0.33	6.36	4.90	1.46
600196.SH	复星医药	0.2636	0.75	2.99	1.94	1.05
601607.SH	上海医药	0.1071	-0.13	5.57	4.10	1.48

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	32.28	56.84	-24.56
600036.SH	招商银行	7.529	2.12	27.65	18.79	8.86
601318.SH	中国平安	6.819	0.62	10.39	17.49	-7.11
601012.SH	隆基股份	4.661	-4.22	19.15	19.69	-0.54
601166.SH	兴业银行	3.458	-1.76	17.51	14.78	2.73
600900.SH	长江电力	3.223	-0.45	1.07	3.91	-2.83
603259.SH	药明康德	3.037	-2.91	28.51	22.95	5.56
600276.SH	恒瑞医药	2.835	-1.5	1.62	3.11	-1.49
600030.SH	中信证券	2.809	0	2.11	3.45	-1.35
601888.SH	中国中免	2.675	3.01	1.95	1.89	0.06
600887.SH	伊利股份	2.651	0	5.31	6.72	-1.40
603501.SH	韦尔股份	2.024	-1.78	6.39	8.99	-2.60
600309.SH	万华化学	1.98	-1.1	3.18	2.79	0.38
600809.SH	山西汾酒	1.925	0.5	4.05	6.12	-2.07
601899.SH	紫金矿业	1.75	0.83	13.23	5.63	7.60
600048.SH	保利发展	1.40	-0.06	3.04	2.44	0.60
601668.SH	中国建筑	1.31	-0.55	6.47	6.51	-0.04
600196.SH	复星医药	0.74	1.42	2.99	1.94	1.05

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。