

成分股监测报告

2022年4月6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28日至4月1日，沪深300指数下跌67.31点。对IF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、食品饮料；对IF指数周度跌幅提供正贡献排名前三的行业分别为：公用事业、交通运输、采掘。上证50指数下跌6.72点。对IH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、医药生物、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、交通运输、公用事业。中证500指数下跌27.65点。对IC指数周度跌幅提供负贡献排名前三的行业分别为：电子、国防军工、汽车；对IC指数周度跌幅提供正贡献排名前三的行业分别为：医药生物、采掘、交通运输。

北上资金净流入42.74亿元，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14.9亿元。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19.93亿元，其中买入425.64亿元，卖出445.58亿元；上证50指数50只成分股中有14只股票有北上资金参与，周内净买入14.27亿元，其中买入193.89亿元，卖出179.62亿元；中证500指数500只成分股中有5只股票有北上资金参与，周内净买入3.12亿元，其中买入17.19亿元，卖出14.07亿元。

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

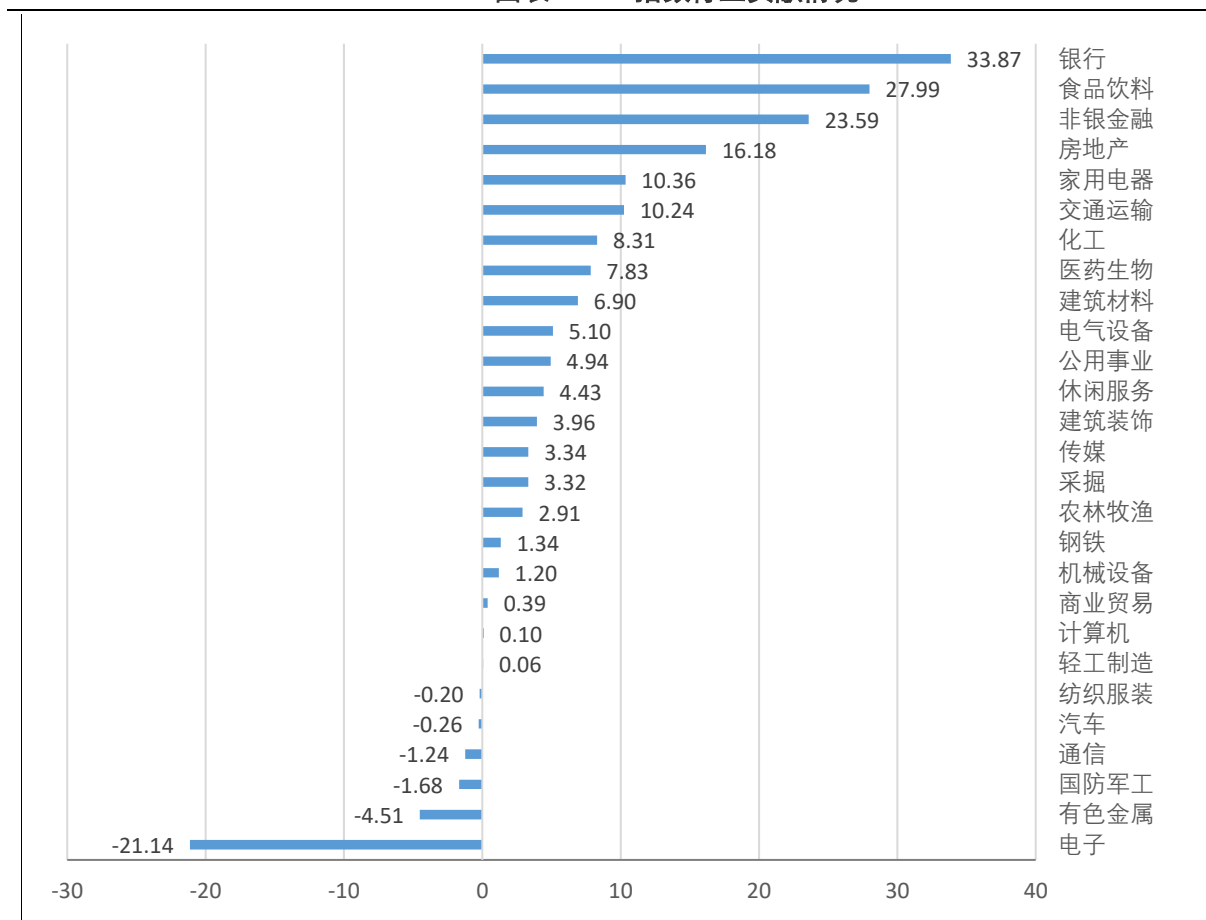
图表目录

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3月28日至4月1日，沪深300指数上涨147.32点。在沪深300指数的300只成分股中，有98只股票对指数上涨提供负贡献，有201只股票提供正贡献，有1只股票贡献为0。分行业看，对IF指数周度涨幅提供负贡献排名前三的行业分别为：电子、有色金属、国防军工；对IF指数周度涨幅提供正贡献排名前三的行业分别为：银行、食品饮料、非银金融。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：立讯精密、隆基股份、闻泰科技、韦尔股份、歌尔股份；对指数周度涨幅提供贡献点分别为：-4.94点，-4.6点，-3.85点，-2.51点，-2.32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、宁德时代、万科A、招商银行、兴业银行；对指数周度涨幅提供贡献点分别为：19.76点，7.68点，7.5点，7.32点，5.31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

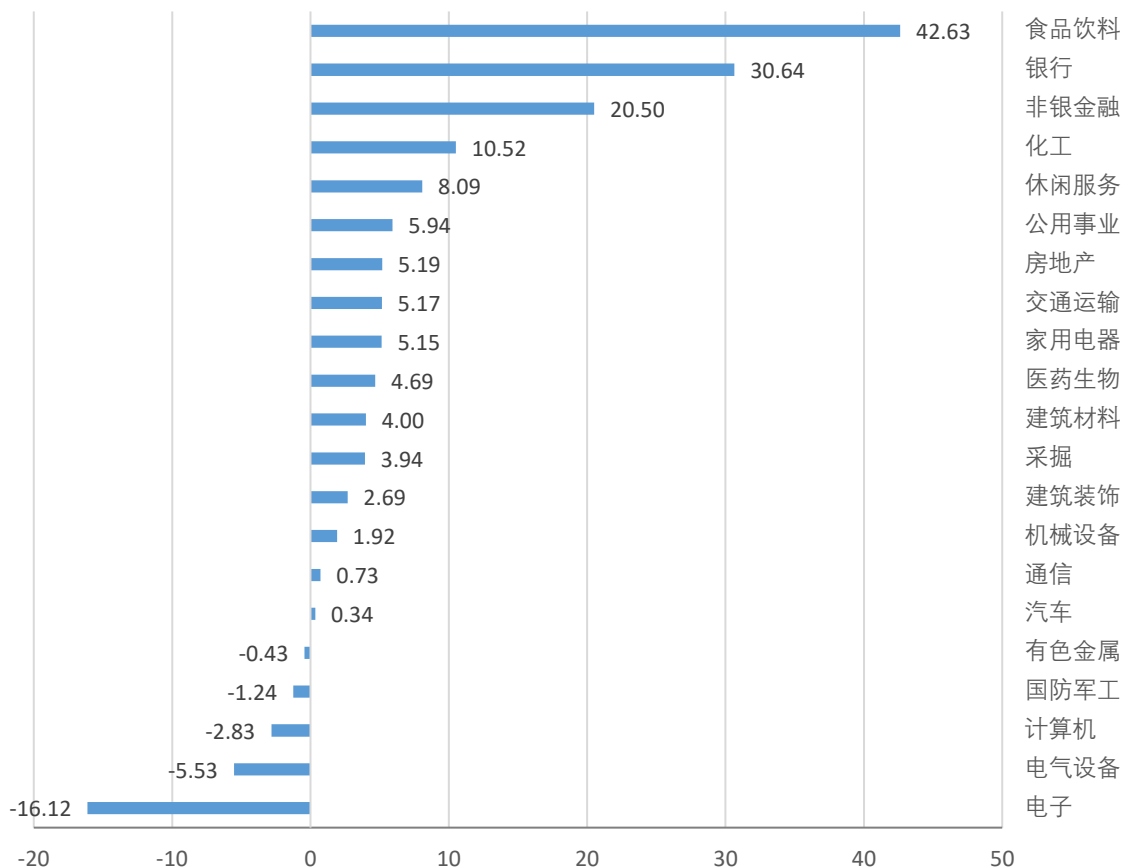
图表 2: IF 指数正/负贡献最大公司

	负贡献		正贡献	
	公司简称	点数	公司简称	点数
1	立讯精密	-4.94	贵州茅台	19.76
2	隆基股份	-4.60	宁德时代	7.68
3	闻泰科技	-3.85	万科A	7.50
4	韦尔股份	-2.51	招商银行	7.32
5	歌尔股份	-2.32	兴业银行	5.31
6	兆易创新	-2.22	东方财富	5.17
7	中兴通讯	-1.73	万华化学	4.75
8	天齐锂业	-1.39	美的集团	4.75
9	沃森生物	-1.38	中国平安	4.44
10	恒生电子	-1.24	中国中免	4.22

数据来源: wind, 兴证期货研发部

2022年3月28日至4月1日, 上证50指数上涨125.98点。在上证50指数的50只成分股中, 有11只股票对指数上涨提供负贡献, 有39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: 电子、电气设备、计算机; 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、银行、非银金融。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: 隆基股份、闻泰科技、韦尔股份、兆易创新、恒生电子; 对指数周度涨幅提供贡献点分别为: -8.74点, -7.16点, -4.7点, -4.16点, -2.31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、招商银行、兴业银行、万华化学、中国平安; 对指数周度涨幅提供贡献点分别为: 36.95点, 13.8点, 9.89点, 8.98点, 8.21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

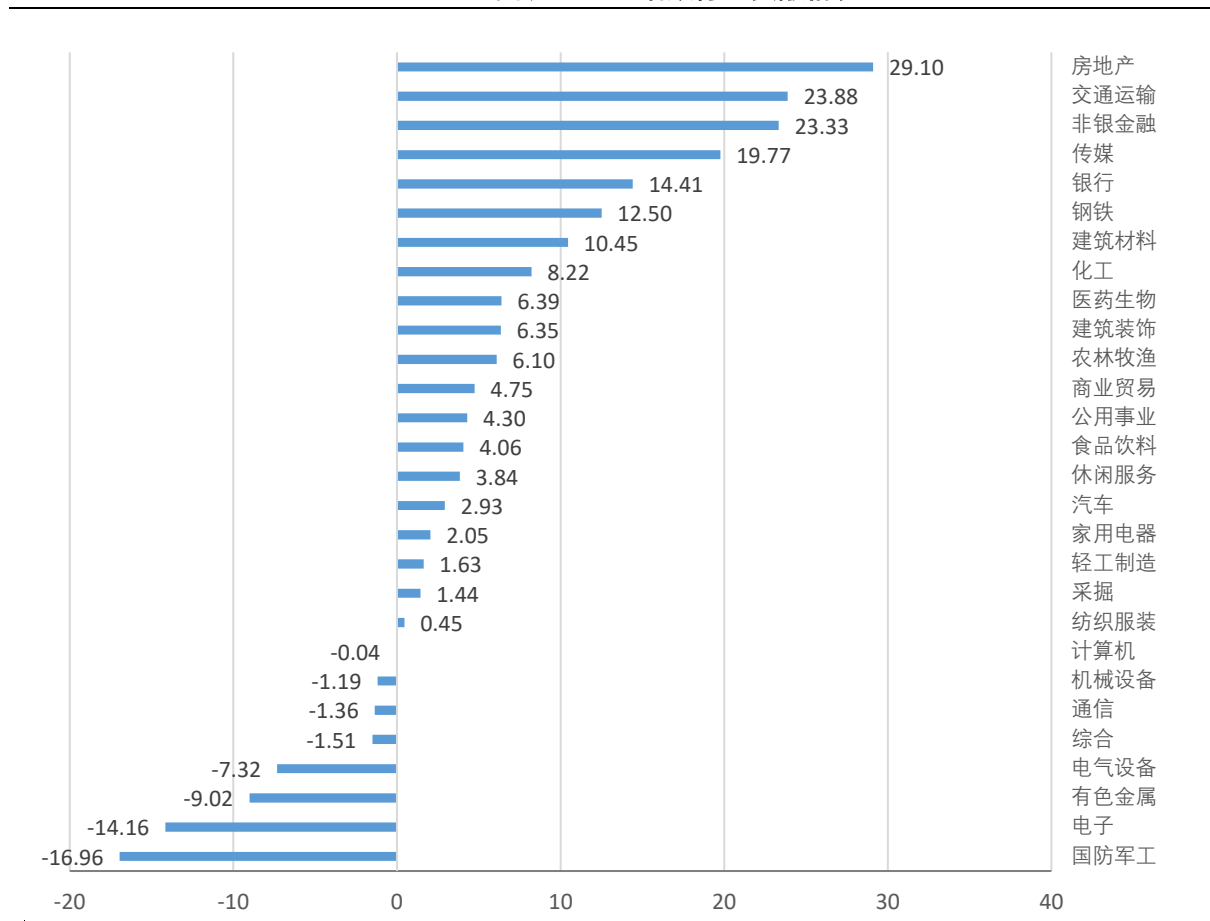
图表 4: IH 指数正/负贡献最大公司

	负贡献		正贡献	
	公司简称	点数	公司简称	点数
1	隆基股份	-8.74	贵州茅台	36.95
2	闻泰科技	-7.16	招商银行	13.80
3	韦尔股份	-4.70	兴业银行	9.89
4	兆易创新	-4.16	万华化学	8.98
5	恒生电子	-2.31	中国平安	8.21
6	航发动力	-1.24	中国中免	8.09
7	药明康德	-0.94	长江电力	5.94
8	用友网络	-0.52	保利发展	5.19
9	紫金矿业	-0.46	中远海控	5.17
10	工业富联	-0.10	海尔智家	5.15

数据来源: wind, 兴证期货研发部

2022年3月28日至4月1日，中证500指数上涨134.4点。在中证500指数的500只成分股中，有185只股票对指数上涨提供负贡献，有310只股票提供正贡献，有5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：国防军工、电子、有色金属；对IC指数周度涨幅提供正贡献排名前三的行业分别为：房地产、交通运输、非银金融。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：思源电气、普洛药业、思瑞浦、中航机电、景嘉微；对指数周度涨幅提供贡献点分别为：-3.99点，-3.64点，-3.1点，-3.03点，-2.99点。对IC指数周度涨幅提供正贡献排名前五的股票分别为：招商轮船、迈为股份、大北农、法拉电子、国元证券；对指数周度涨幅提供贡献点分别为：5.58点，5.12点，4.79点，4.41点，3.71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	思源电气	-3.99	招商轮船	5.58
2	普洛药业	-3.64	迈为股份	5.12
3	思瑞浦	-3.10	大北农	4.79
4	中航机电	-3.03	法拉电子	4.41
5	景嘉微	-2.99	国元证券	3.71
6	东山精密	-2.83	蓝色光标	3.56
7	杰瑞股份	-2.70	华润三九	3.43
8	华工科技	-2.55	中远海发	3.36
9	巨星科技	-2.51	新宙邦	3.28
10	立昂微	-2.45	圆通速递	3.19

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28日至4月1日,北上资金净流入42.74亿元,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95.95亿元。在每日前十大活跃股中,沪深300指数300只成分股中有35只股票有北上资金参与,周内北上资金净买入96.54亿元,其中买入443.79亿元,卖出347.25亿元;上证50指数50只成分股中有17只股票有北上资金参与,周内净买入44.44亿元,其中买入214.03亿元,卖出169.59亿元;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0.6亿元,其中买入4.11亿元,卖出4.7亿元。

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	5.8358	2.19	54.90	39.01	15.89
300750.SZ	宁德时代	3.6037	0.11	48.04	31.54	16.51
600036.SH	招商银行	2.7107	1.13	23.45	27.36	-3.90
601318.SH	中国平安	2.5024	0.34	6.50	4.05	2.44
000858.SZ	五粮液	1.9653	1.78	27.62	23.18	4.44
000333.SZ	美的集团	1.6687	-1.23	2.25	2.64	-0.40
601012.SH	隆基股份	1.6645	-2.24	29.43	19.72	9.70
300059.SZ	东方财富	1.3431	-0.93	29.66	20.04	9.62
601166.SH	兴业银行	1.2601	-0.95	8.93	10.51	-1.58
002475.SZ	立讯精密	1.1398	-2	19.18	12.10	7.08
002594.SZ	比亚迪	1.1128	-0.14	17.95	15.03	2.92
600030.SH	中信证券	1.0202	0	3.70	3.00	0.70
603259.SH	药明康德	1.0107	-1.44	16.78	15.63	1.16
601888.SH	中国中免	0.9466	1.58	13.80	15.41	-1.61
000568.SZ	泸州老窖	0.8315	0.11	3.29	2.48	0.81
603501.SH	韦尔股份	0.7332	-0.96	2.60	2.78	-0.17
600309.SH	万华化学	0.7114	-0.59	2.99	5.07	-2.08
002714.SZ	牧原股份	0.6889	-1.27	2.43	1.55	0.88
601899.SH	紫金矿业	0.6412	0.45	12.52	7.31	5.21
300274.SZ	阳光电源	0.6376	0.63	9.42	8.15	1.27
002352.SZ	顺丰控股	0.6349	-0.04	6.44	8.21	-1.77
000002.SZ	万科A	0.6318	-0.64	6.97	6.00	0.97
002812.SZ	恩捷股份	0.6173	-0.35	12.34	5.00	7.34
002241.SZ	歌尔股份	0.617	-0.92	15.49	16.53	-1.04
300014.SZ	亿纬锂能	0.5725	0.46	2.86	1.46	1.40
601919.SH	中远海控	0.5619	-1.14	10.31	4.54	5.78
600438.SH	通威股份	0.5202	-0.04	5.52	1.32	4.21
300015.SZ	爱尔眼科	0.5168	-0.59	3.06	8.51	-5.45
002460.SZ	赣锋锂业	0.4928	0.22	13.13	9.38	3.75
600406.SH	国电南瑞	0.4862	-0.82	6.17	3.58	2.59
601668.SH	中国建筑	0.4779	-0.3	12.00	5.13	6.86
600745.SH	闻泰科技	0.4399	-0.46	5.82	4.38	1.44
600893.SH	航发动力	0.3837	-0.19	1.90	2.18	-0.28
300347.SZ	泰格医药	0.2816	-0.33	3.45	2.29	1.16
600196.SH	复星医药	0.2636	0.75	2.88	2.19	0.69

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	54.90	39.01	15.89
600036.SH	招商银行	7.529	2.12	23.45	27.36	-3.90
601318.SH	中国平安	6.819	0.62	6.50	4.05	2.44
601012.SH	隆基股份	4.661	-4.22	29.43	19.72	9.70
601166.SH	兴业银行	3.458	-1.76	8.93	10.51	-1.58
603259.SH	药明康德	3.037	-2.91	16.78	15.63	1.16
600030.SH	中信证券	2.809	0	3.70	3.00	0.70
601888.SH	中国中免	2.675	3.01	13.80	15.41	-1.61
603501.SH	韦尔股份	2.024	-1.78	2.60	2.78	-0.17
600309.SH	万华化学	1.98	-1.1	2.99	5.07	-2.08
601899.SH	紫金矿业	1.746	0.83	12.52	7.31	5.21
600438.SH	通威股份	1.516	-0.07	5.52	1.32	4.21
601919.SH	中远海控	1.477	-2.02	10.31	4.54	5.78
601668.SH	中国建筑	1.31	-0.55	12.00	5.13	6.86
600745.SH	闻泰科技	1.21	-0.84	5.82	4.38	1.44
600893.SH	航发动力	1.06	-0.35	1.90	2.18	-0.28
600196.SH	复星医药	0.74	1.42	2.88	2.19	0.69

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	0.419	-0.31	4.11	4.70	-0.60

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。