

成分股监测报告

2022年4月13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4月4日至4月8日，沪深300指数下跌28.07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指数上涨6.99点。对IH指数周度涨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指数周度涨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138.89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。

北上资金净流出65.57亿元，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111.25亿元。在每日前十大活跃股中，沪深300指数300只成分股中有80只股票有北上资金参与，周内北上资金净卖出95.69亿元，其中买入5611.12亿元，卖出5706.81亿元；上证50指数50只成分股中有30只股票有北上资金参与，周内净买入13.43亿元，其中买入2743.57亿元，卖出2730.14亿元；中证500指数500只成分股中有11只股票有北上资金参与，周内净卖出5.93亿元，其中买入50.13亿元，卖出56.05亿元。

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

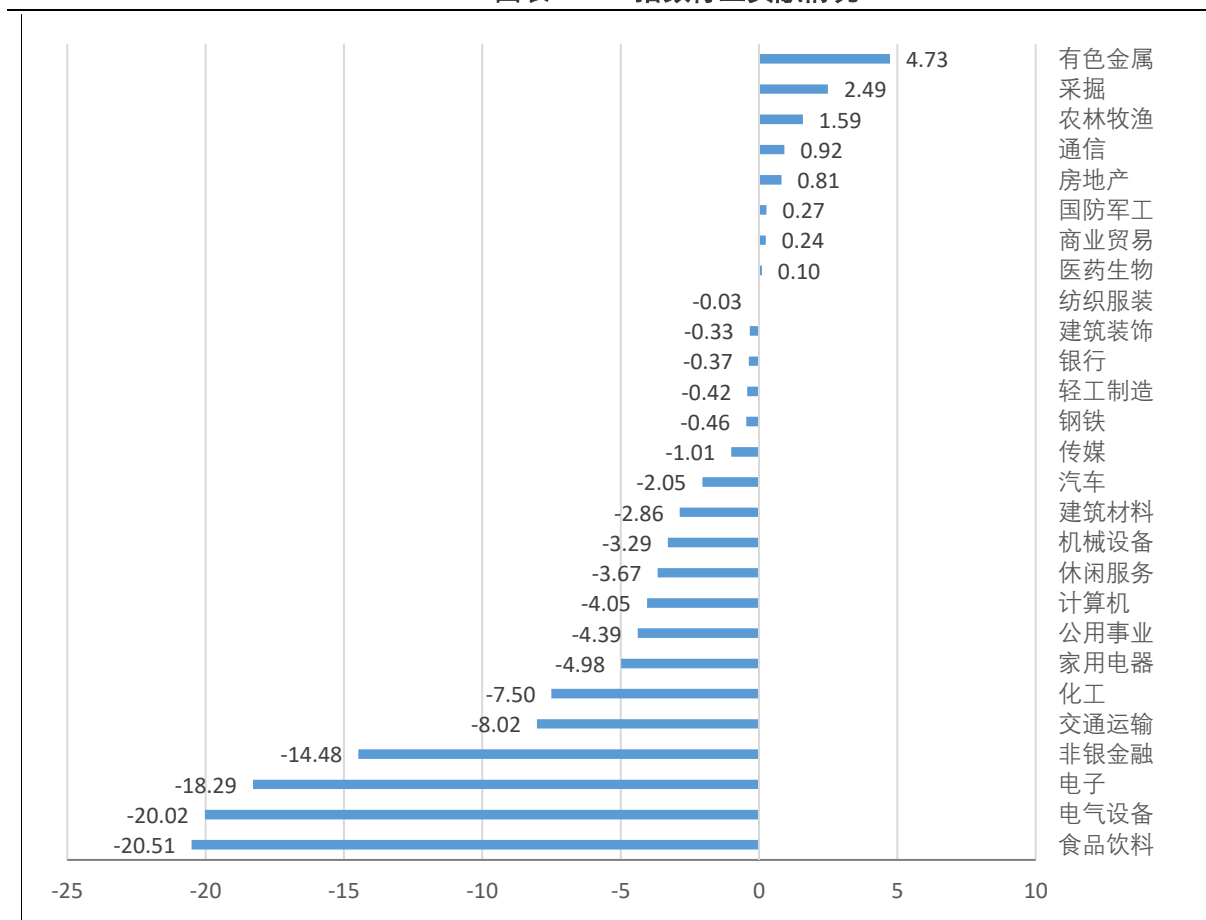
图表目录

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.....	10
图表 9: IC 北上资金流入情况.....	10

1. 成分股指数拉动情况

2022年4月4日至4月8日，沪深300指数下跌28.07点。在沪深300指数的300只成分股中，有191只股票对指数下跌提供负贡献，有102只股票提供正贡献，有7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：宁德时代、隆基股份、恒瑞医药、立讯精密、中国中免；对指数周度跌幅提供贡献点分别为：-3.62点，-2.35点，-1.73点，-1.56点，-1.16点。对IF指数周度跌幅提供正贡献排名前五的股票分别为：三一重工、中国建筑、长江电力、沃森生物、比亚迪；对指数周度跌幅提供贡献点分别为：1.31点，1.16点，1.13点，0.83点，0.83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

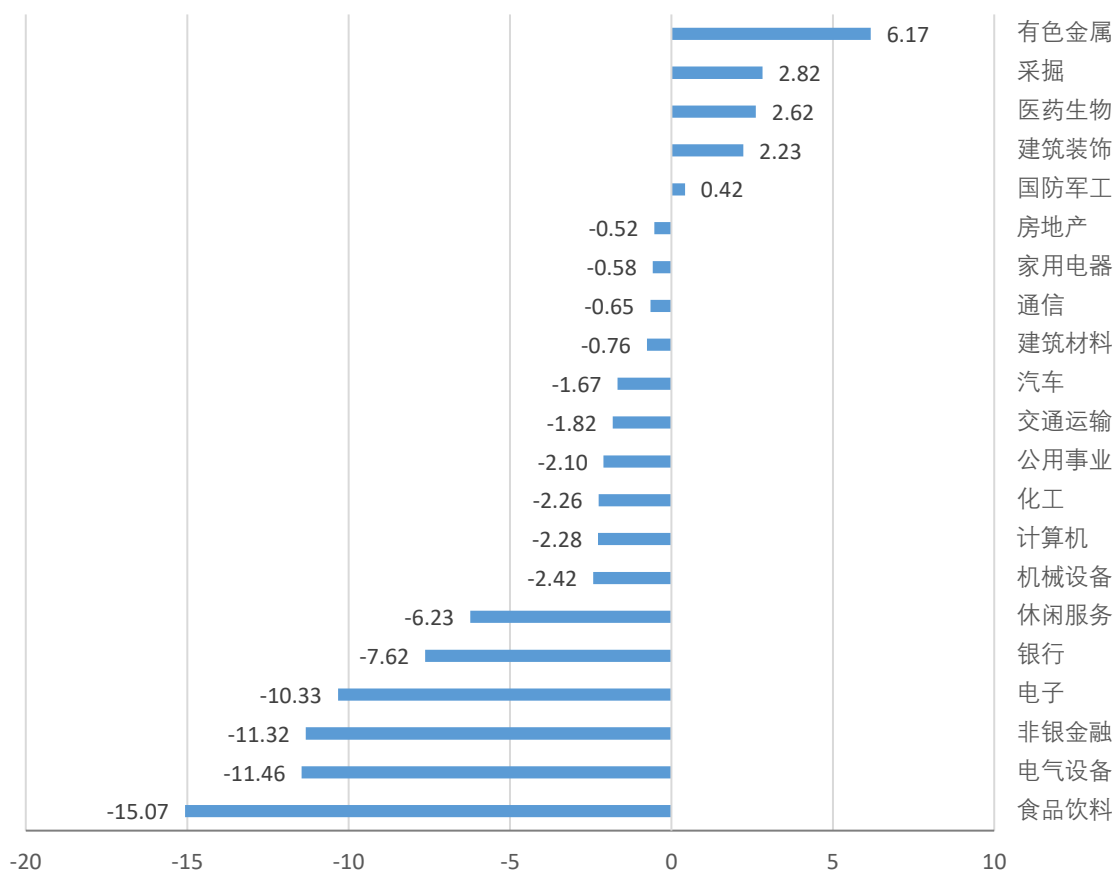
图表 2: IF 指数正/负贡献最大公司

	负贡献		正贡献	
	公司简称	点数	公司简称	点数
1	宁德时代	-3.62	三一重工	1.31
2	隆基股份	-2.35	中国建筑	1.16
3	恒瑞医药	-1.73	长江电力	1.13
4	立讯精密	-1.56	沃森生物	0.83
5	中国中免	-1.16	比亚迪	0.83
6	韦尔股份	-1.15	兴业银行	0.76
7	海康威视	-1.06	中国电建	0.69
8	中远海控	-1.06	平安银行	0.66
9	牧原股份	-0.97	中国中铁	0.63
10	亿纬锂能	-0.92	紫金矿业	0.61

数据来源: wind, 兴证期货研发部

2022年4月4日至4月8日, 上证50指数上涨6.99点。在上证50指数的50只成分股中, 有19只股票对指数上涨提供负贡献, 有29只股票提供正贡献, 有2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: 食品饮料、电气设备、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: 有色金属、采掘、医药生物。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: 三一重工、中国建筑、长江电力、兴业银行、紫金矿业; 对指数周度涨幅提供贡献点分别为: -1.27点, -1.11点, -1.09点, -0.73点, -0.59点。对IH指数周度涨幅提供正贡献排名前五的股票分别为: 隆基股份、恒瑞医药、中国中免、韦尔股份、中远海控; 对指数周度涨幅提供贡献点分别为: 2.32点, 1.69点, 1.15点, 1.12点, 0.98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

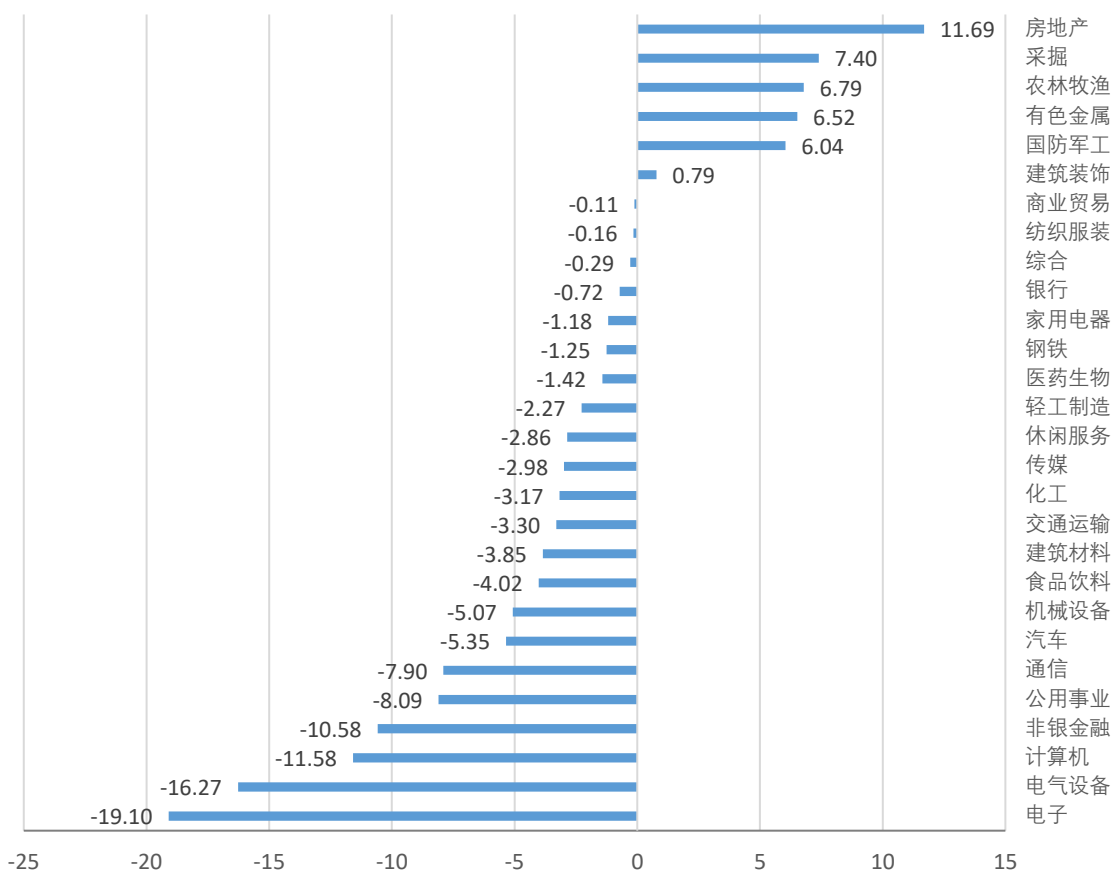
图表 4: IH 指数正/负贡献最大公司

	负贡献		正贡献	
	公司简称	点数	公司简称	点数
1	三一重工	-1.27	隆基股份	2.32
2	中国建筑	-1.11	恒瑞医药	1.69
3	长江电力	-1.09	中国中免	1.15
4	兴业银行	-0.73	韦尔股份	1.12
5	紫金矿业	-0.59	中远海控	0.98
6	万华化学	-0.44	药明康德	0.87
7	中国平安	-0.30	通威股份	0.66
8	海螺水泥	-0.28	山西汾酒	0.65
9	贵州茅台	-0.28	闻泰科技	0.62
10	中国神华	-0.25	航发动力	0.46

数据来源: wind, 兴证期货研发部

2022年4月4日至4月8日，中证500指数下跌138.89点。在中证500指数的500只成分股中，有355只股票对指数下跌提供负贡献，有139只股票提供正贡献，有6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：容百科技、圆通速递、法拉电子、思瑞浦、长信科技；对指数周度跌幅提供贡献点分别为：-3.28点，-2.78点，-2.52点，-2.33点，-2.28点。对IC指数周度跌幅提供正贡献排名前五的股票分别为：以岭药业、兴发集团、华菱钢铁、赤峰黄金、铜陵有色；对指数周度跌幅提供贡献点分别为：3.04点，2.59点，2点，1.91点，1.83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	容百科技	-3.28	以岭药业	3.04
2	圆通速递	-2.78	兴发集团	2.59
3	法拉电子	-2.52	华菱钢铁	2.00
4	思瑞浦	-2.33	赤峰黄金	1.91
5	长信科技	-2.28	铜陵有色	1.83
6	安琪酵母	-2.25	明阳智能	1.66
7	中天科技	-2.18	扬农化工	1.46
8	思源电气	-2.04	中国化学	1.08
9	斯达半导	-2.04	银泰黄金	1.07
10	博腾股份	-1.96	马钢股份	0.92

数据来源: wind, 兴证期货研发部

2. 北上资金个股流向

2022年4月4日至4月8日,北上资金净流出65.57亿元,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111.25亿元。在每日前十大活跃股中,沪深300指数300只成分股中有80只股票有北上资金参与,周内北上资金净卖出95.69亿元,其中买入5611.12亿元,卖出5706.81亿元;上证50指数50只成分股中有30只股票有北上资金参与,周内净买入13.43亿元,其中买入2743.57亿元,卖出2730.14亿元;中证500指数500只成分股中有11只股票有北上资金参与,周内净卖出5.93亿元,其中买入50.13亿元,卖出56.05亿元。

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	590.93	701.24	-110.31
300750.SZ	宁德时代	3.60	0.11	583.14	678.10	-94.96
600036.SH	招商银行	2.71	1.13	377.10	294.84	82.26
601318.SH	中国平安	2.50	0.34	221.75	250.27	-28.52
000858.SZ	五粮液	1.97	1.78	290.19	322.07	-31.89
000333.SZ	美的集团	1.67	-1.23	45.19	18.07	27.13
601012.SH	隆基股份	1.66	-2.24	321.52	303.73	17.79
300059.SZ	东方财富	1.34	-0.93	298.85	320.99	-22.14
601166.SH	兴业银行	1.26	-0.95	166.33	144.86	21.47
600900.SH	长江电力	1.18	-0.24	52.42	43.02	9.41
002475.SZ	立讯精密	1.14	-2.00	174.96	167.42	7.54
002594.SZ	比亚迪	1.11	-0.14	208.48	230.81	-22.33
600276.SH	恒瑞医药	1.02	-0.80	18.42	50.37	-31.95
600030.SH	中信证券	1.02	0.00	56.74	67.86	-11.12
603259.SH	药明康德	1.01	-1.44	224.98	235.91	-10.93
601888.SH	中国中免	0.95	1.58	119.93	139.34	-19.41
600887.SH	伊利股份	0.94	0.00	60.12	76.45	-16.33
000568.SZ	泸州老窖	0.83	0.11	28.25	31.87	-3.62
000651.SZ	格力电器	0.81	-0.87	37.01	44.56	-7.55
300760.SZ	迈瑞医疗	0.75	-1.29	69.63	90.46	-20.83
603501.SH	韦尔股份	0.73	-0.96	96.65	102.11	-5.47
000001.SZ	平安银行	0.73	0.04	54.55	52.79	1.77
600309.SH	万华化学	0.71	-0.59	16.18	26.65	-10.46
000725.SZ	京东方 A	0.69	0.27	4.69	0.70	3.99
002714.SZ	牧原股份	0.69	-1.27	32.59	32.06	0.53
600809.SH	山西汾酒	0.69	0.27	28.19	27.77	0.42
002142.SZ	宁波银行	0.68	-0.50	5.92	7.54	-1.62
601899.SH	紫金矿业	0.64	0.45	189.31	114.58	74.73
300274.SZ	阳光电源	0.64	0.63	199.56	129.77	69.78
002352.SZ	顺丰控股	0.63	-0.04	26.05	25.82	0.23
000002.SZ	万科 A	0.63	-0.64	33.96	29.63	4.33
002812.SZ	恩捷股份	0.62	-0.35	138.46	163.72	-25.27
002241.SZ	歌尔股份	0.62	-0.92	67.92	57.86	10.06
600031.SH	三一重工	0.61	-1.29	23.59	21.30	2.29
603288.SH	海天味业	0.61	0.51	12.66	12.35	0.31
600436.SH	片仔癀	0.59	-0.57	2.44	3.16	-0.72
300124.SZ	汇川技术	0.58	-0.19	23.40	22.55	0.85
300014.SZ	亿纬锂能	0.57	0.46	108.15	103.57	4.58
601919.SH	中远海控	0.56	-1.14	30.57	25.52	5.06
600438.SH	通威股份	0.52	-0.04	13.26	6.42	6.85

300015.SZ	爱尔眼科	0.52	-0.59	30.69	54.76	-24.07
600048.SH	保利发展	0.51	-0.03	6.72	3.80	2.92
600690.SH	海尔智家	0.50	-0.17	1.52	3.31	-1.79
002460.SZ	赣锋锂业	0.49	0.22	162.02	168.94	-6.92
600406.SH	国电南瑞	0.49	-0.82	56.72	28.94	27.78
000063.SZ	中兴通讯	0.48	-0.72	1.55	4.77	-3.21
601668.SH	中国建筑	0.48	-0.30	61.68	47.12	14.55
603799.SH	华友钴业	0.47	-0.10	13.99	9.42	4.56
600585.SH	海螺水泥	0.45	-0.75	15.39	7.17	8.22
600745.SH	闻泰科技	0.44	-0.46	9.37	5.96	3.41
300122.SZ	智飞生物	0.44	-0.60	5.17	4.12	1.05
002049.SZ	紫光国微	0.44	-0.52	4.75	1.77	2.98
600111.SH	北方稀土	0.44	0.20	2.09	4.14	-2.04
603986.SH	兆易创新	0.43	-0.74	2.71	3.09	-0.38
601688.SH	华泰证券	0.41	-0.16	11.37	3.64	7.73
002129.SZ	中环股份	0.41	0.08	3.26	1.82	1.44
000661.SZ	长春高新	0.40	-1.90	18.01	16.02	2.00
002027.SZ	分众传媒	0.39	-0.25	7.73	7.75	-0.02
600893.SH	航发动力	0.38	-0.19	1.90	2.18	-0.28
002371.SZ	北方华创	0.38	-0.63	29.63	49.07	-19.44
300450.SZ	先导智能	0.35	0.01	8.54	8.16	0.38
002709.SZ	天赐材料	0.29	0.28	6.33	7.36	-1.03
600905.SH	三峡能源	0.29	-0.18	13.21	9.56	3.65
600010.SH	宝钢股份	0.29	-0.38	4.59	3.50	1.09
300347.SZ	泰格医药	0.28	-0.33	9.82	7.19	2.63
688599.SH	天合光能	0.27	0.25	7.31	5.92	1.39
600588.SH	用友网络	0.27	-0.06	3.97	2.03	1.94
600196.SH	复星医药	0.26	0.75	5.86	4.13	1.74
002821.SZ	凯莱英	0.26	-0.10	8.10	10.77	-2.68
601658.SH	邮储银行	0.25	-0.08	3.28	2.13	1.15
601600.SH	中国铝业	0.22	-0.10	6.28	5.80	0.48
601225.SH	陕西煤业	0.22	0.18	6.80	1.46	5.34
600009.SH	上海机场	0.21	0.36	3.59	3.59	0.00
600176.SH	中国巨石	0.20	-0.21	0.78	5.78	-5.00
601006.SH	大秦铁路	0.17	0.08	4.93	4.97	-0.04
000977.SZ	浪潮信息	0.17	-0.09	5.11	1.54	3.57
601868.SH	中国能建	0.16	-0.27	4.36	3.81	0.55
601838.SH	成都银行	0.12	-0.08	2.12	4.65	-2.53
601607.SH	上海医药	0.11	-0.13	5.57	4.10	1.48
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	590.93	701.24	-110.31
600036.SH	招商银行	7.53	2.12	377.10	294.84	82.26
601318.SH	中国平安	6.82	0.62	221.75	250.27	-28.52
601012.SH	隆基股份	4.66	-4.22	321.52	303.73	17.79
601166.SH	兴业银行	3.46	-1.76	166.33	144.86	21.47
600900.SH	长江电力	3.22	-0.45	52.42	43.02	9.41
603259.SH	药明康德	3.04	-2.91	224.98	235.91	-10.93
600276.SH	恒瑞医药	2.84	-1.50	18.42	50.37	-31.95
600030.SH	中信证券	2.81	0.00	56.74	67.86	-11.12
601888.SH	中国中免	2.68	3.01	119.93	139.34	-19.41
600887.SH	伊利股份	2.65	0.00	60.12	76.45	-16.33
603501.SH	韦尔股份	2.02	-1.78	96.65	102.11	-5.47
600309.SH	万华化学	1.98	-1.10	16.18	26.65	-10.46
600809.SH	山西汾酒	1.93	0.50	28.19	27.77	0.42
601899.SH	紫金矿业	1.75	0.83	189.31	114.58	74.73
600031.SH	三一重工	1.69	-2.40	23.59	21.30	2.29
603288.SH	海天味业	1.66	0.94	12.66	12.35	0.31
600436.SH	片仔癀	1.65	-1.06	2.44	3.16	-0.72
600438.SH	通威股份	1.52	-0.07	13.26	6.42	6.85
601919.SH	中远海控	1.48	-2.02	30.57	25.52	5.06
600690.SH	海尔智家	1.41	-0.32	1.52	3.31	-1.79
600048.SH	保利发展	1.40	-0.06	6.72	3.80	2.92
601668.SH	中国建筑	1.31	-0.55	61.68	47.12	14.55
600585.SH	海螺水泥	1.21	-1.35	15.39	7.17	8.22
600745.SH	闻泰科技	1.21	-0.84	9.37	5.96	3.41
603986.SH	兆易创新	1.17	-1.38	2.71	3.09	-0.38
601688.SH	华泰证券	1.14	-0.30	11.37	3.64	7.73
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	5.86	4.13	1.74
600588.SH	用友网络	0.73	-0.12	3.97	2.03	1.94

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
600522.SH	中天科技	0.642	-0.66	3.15	8.81	-5.66
601615.SH	明阳智能	0.581	0.8	3.44	4.45	-1.02
600884.SH	杉杉股份	0.54	0.01	9.20	8.09	1.12
688005.SH	容百科技	0.442	-0.01	9.89	5.63	4.25

600141.SH	兴发集团	0.419	-0.31	6.10	8.38	-2.28
300699.SZ	光威复材	0.374	-0.36	2.93	5.42	-2.49
601168.SH	西部矿业	0.369	-0.04	3.09	2.12	0.96
000630.SZ	铜陵有色	0.365	0.27	2.69	2.86	-0.17
601689.SH	拓普集团	0.332	-0.71	2.09	3.04	-0.95
000932.SZ	华菱钢铁	0.301	-0.47	3.89	5.70	-1.81
000807.SZ	云铝股份	0.276	0.11	3.65	1.54	2.12

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。