

成分股监测报告

2022年4月27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18日至4月22日，沪深300指数下跌139.68点。对IF指数周度跌幅提供负贡献排名前三的行业分别为：电气设备、医药生物、非银金融；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、农林牧渔、通信。上证50指数下跌88.32点。对IH指数周度跌幅提供负贡献排名前三的行业分别为：银行、非银金融、医药生物；对IH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、家用电器、通信。中证500指数下跌278.55点。对IC指数周度跌幅提供负贡献排名前三的行业分别为：医药生物、电子、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：纺织服装、休闲服务、家用电器。

北上资金净流入4.45亿元，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12.25亿元。在每日前十大活跃股中，沪深300指数300只成分股中有28只股票有北上资金参与，周内北上资金净卖出10.02亿元，其中买入435.13亿元，卖出445.15亿元；上证50指数50只成分股中有14只股票有北上资金参与，周内净卖出7.25亿元，其中买入230.49亿元，卖出237.74亿元；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2.23亿元，其中买入1.77亿元，卖出4亿元。

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

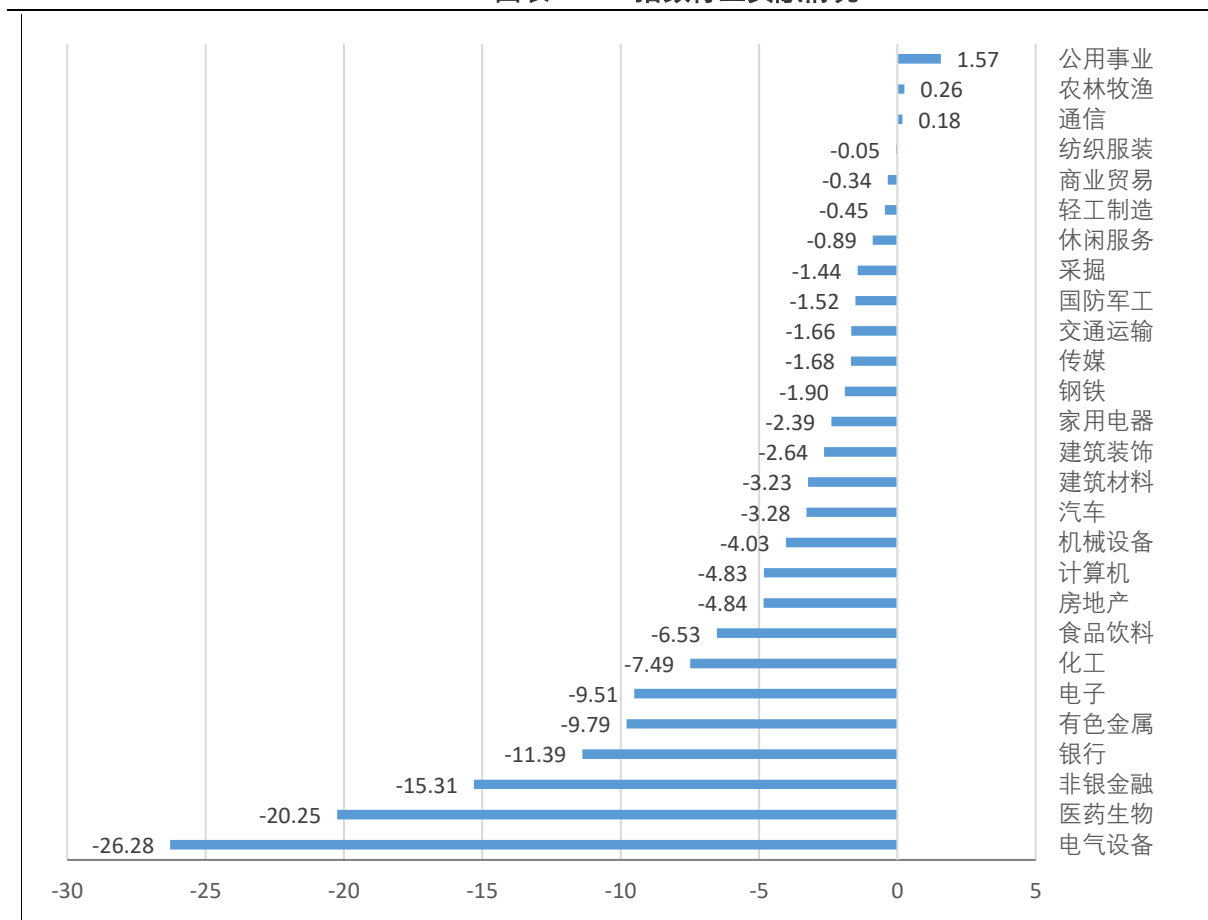
图表目录

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4月18日至4月22日，沪深300指数下跌139.68点。在沪深300指数的300只成分股中，有259只股票对指数下跌提供负贡献，有40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：电气设备、医药生物、非银金融；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、农林牧渔、通信。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、招商银行、阳光电源、隆基股份、贵州茅台；对指数周度跌幅提供贡献点分别为：-9.27点，-8.19点，-4.78点，-3.6点，-3.48点。对IF指数周度跌幅提供正贡献排名前五的股票分别为：牧原股份、海康威视、华能国际、大华股份、长江电力；对指数周度跌幅提供贡献点分别为：1.1点，0.79点，0.53点，0.51点，0.48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

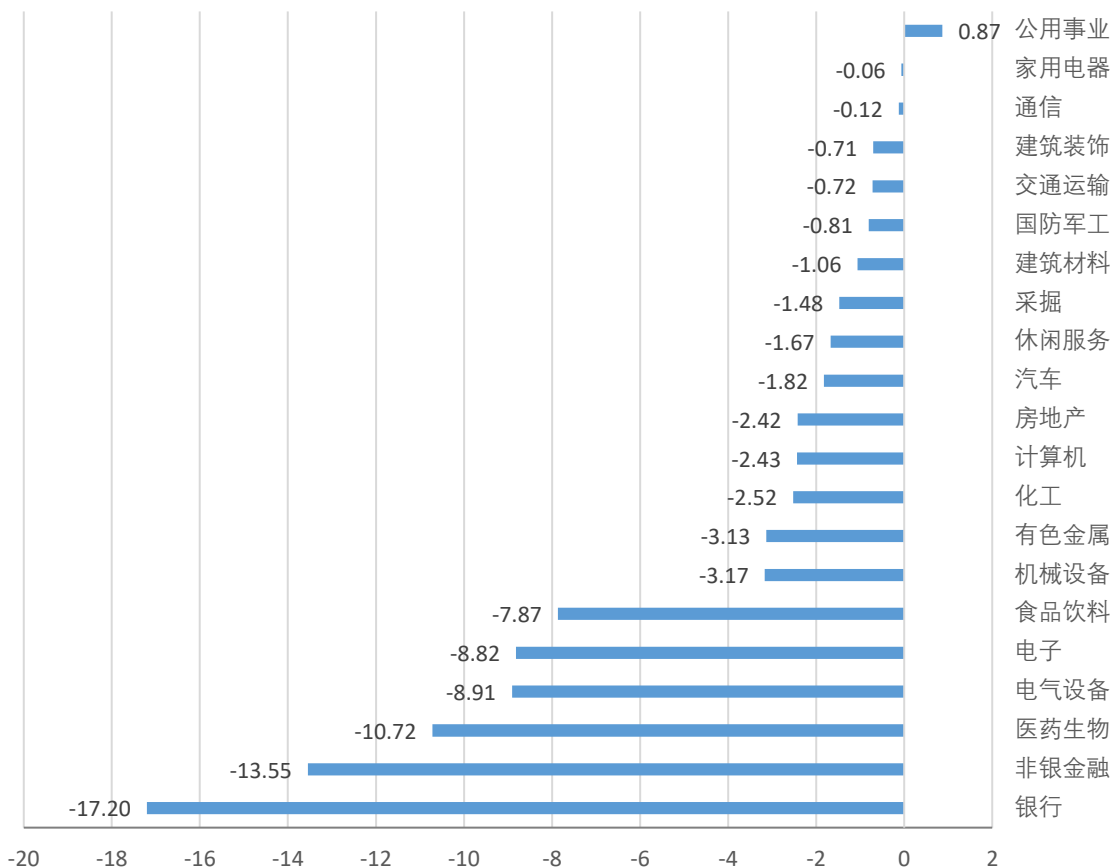
图表 2: IF 指数正/负贡献最大公司

	负贡献		正贡献	
	公司简称	点数	公司简称	点数
1	宁德时代	-9.27	牧原股份	1.10
2	招商银行	-8.19	海康威视	0.79
3	阳光电源	-4.78	华能国际	0.53
4	隆基股份	-3.60	大华股份	0.51
5	贵州茅台	-3.48	长江电力	0.48
6	韦尔股份	-3.43	洋河股份	0.43
7	中国平安	-3.11	工商银行	0.41
8	东方财富	-2.94	中国广核	0.36
9	迈瑞医疗	-2.80	石头科技	0.34
10	亿纬锂能	-2.39	三环集团	0.23

数据来源: wind, 兴证期货研发部

2022年4月18日至4月22日, 上证50指数下跌88.32点。在上证50指数的50只成分股中, 有47只股票对指数下跌提供负贡献, 有3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: 银行、非银金融、医药生物; 对IH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、家用电器、通信。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: 招商银行、隆基股份、贵州茅台、韦尔股份、中国平安; 对指数周度跌幅提供贡献点分别为: -15.09点, -6.7点, -6.37点, -6.28点, -5.63点。对IH指数周度跌幅提供正贡献排名前五的股票分别为: 长江电力、工商银行、农业银行、中国联通、海尔智家; 对指数周度跌幅提供贡献点分别为: 0.87点, 0.74点, 0.18点, -0.06点, -0.06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

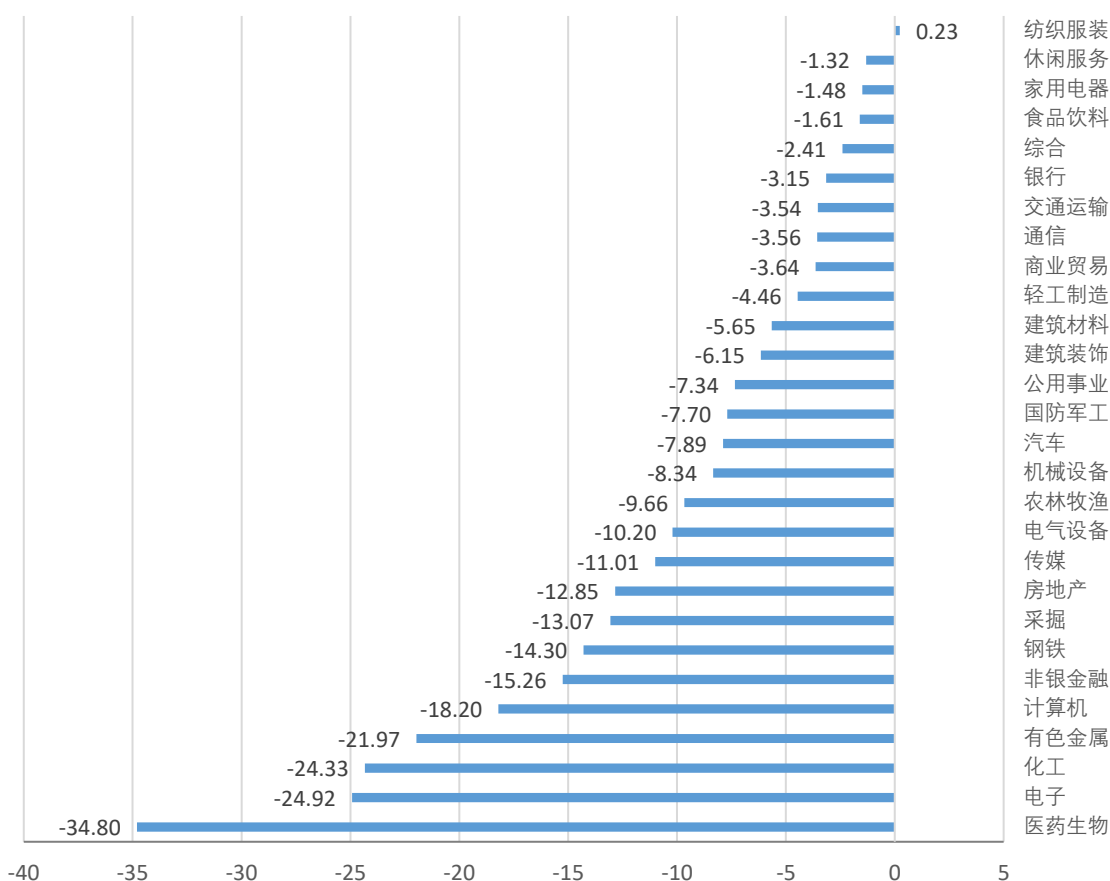
图表 4: IH 指数正/负贡献最大公司

	负贡献		正贡献	
	公司简称	点数	公司简称	点数
1	招商银行	-15.09	长江电力	0.87
2	隆基股份	-6.70	工商银行	0.74
3	贵州茅台	-6.37	农业银行	0.18
4	韦尔股份	-6.28	中国联通	-0.06
5	中国平安	-5.63	海尔智家	-0.06
6	药明康德	-4.53	中国电信	-0.07
7	三一重工	-3.17	中国石化	-0.07
8	中信证券	-2.92	新华保险	-0.09
9	兴业银行	-2.83	浦发银行	-0.20
10	紫金矿业	-2.50	中国人寿	-0.22

数据来源: wind, 兴证期货研发部

2022年4月18日至4月22日，中证500指数下跌278.55点。在中证500指数的500只成分股中，有443只股票对指数下跌提供负贡献，有54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：医药生物、电子、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：纺织服装、休闲服务、家用电器。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：美锦能源、格林美、杰瑞股份、以岭药业、中国化学；对指数周度跌幅提供贡献点分别为：-3.58点，-3.55点，-3.37点，-2.99点，-2.95点。对IC指数周度跌幅提供正贡献排名前五的股票分别为：迈为股份、横店东磁、珀莱雅、内蒙华电、航发控制；对指数周度跌幅提供贡献点分别为：3.15点，0.9点，0.84点，0.78点，0.69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	美锦能源	-3.58	迈为股份	3.15
2	格林美	-3.55	横店东磁	0.90
3	杰瑞股份	-3.37	珀莱雅	0.84
4	以岭药业	-2.99	内蒙华电	0.78
5	中国化学	-2.95	航发控制	0.69
6	大北农	-2.87	中航电子	0.60
7	卫士通	-2.61	中远海能	0.60
8	博腾股份	-2.60	益生股份	0.56
9	劲嘉股份	-2.55	信立泰	0.56
10	振华科技	-2.52	涪陵榨菜	0.55

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18日至4月22日,北上资金净流入4.45亿元,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12.25亿元。在每日前十大活跃股中,沪深300指数300只成分股中有28只股票有北上资金参与,周内北上资金净卖出10.02亿元,其中买入435.13亿元,卖出445.15亿元;上证50指数50只成分股中有14只股票有北上资金参与,周内净卖出7.25亿元,其中买入230.49亿元,卖出237.74亿元;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2.23亿元,其中买入1.77亿元,卖出4亿元。

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
600036.SH	招商银行	2.71	1.13	35.74	62.19	-26.46
300059.SZ	东方财富	1.34	-0.93	14.33	26.03	-11.70
300274.SZ	阳光电源	0.64	0.63	20.63	28.60	-7.97
603501.SH	韦尔股份	0.73	-0.96	6.90	12.79	-5.89
002475.SZ	立讯精密	1.14	-2.00	11.88	16.84	-4.96
601012.SH	隆基股份	1.66	-2.24	22.87	26.83	-3.96
000858.SZ	五粮液	1.97	1.78	19.34	23.20	-3.87
600048.SH	保利发展	0.51	-0.03	5.55	8.18	-2.63
300760.SZ	迈瑞医疗	0.75	-1.29	6.15	8.34	-2.19
601318.SH	中国平安	2.50	0.34	12.67	13.74	-1.07
000333.SZ	美的集团	1.67	-1.23	2.24	3.26	-1.03
002460.SZ	赣锋锂业	0.49	0.22	2.80	3.56	-0.76
601899.SH	紫金矿业	0.64	0.45	16.87	16.88	-0.01
600887.SH	伊利股份	0.94	0.00	9.92	9.91	0.01
601888.SH	中国中免	0.95	1.58	11.78	11.54	0.25
000002.SZ	万科A	0.63	-0.64	7.69	7.06	0.63
300124.SZ	汇川技术	0.58	-0.19	3.19	2.53	0.66
002129.SZ	中环股份	0.41	0.08	3.89	3.13	0.76
603259.SH	药明康德	1.01	-1.44	7.83	6.45	1.38
002594.SZ	比亚迪	1.11	-0.14	16.66	15.24	1.42
601166.SH	兴业银行	1.26	-0.95	5.62	3.94	1.68
002714.SZ	牧原股份	0.69	-1.27	15.24	12.80	2.44
600276.SH	恒瑞医药	1.02	-0.80	4.55	1.97	2.58
601668.SH	中国建筑	0.48	-0.30	12.71	10.01	2.70
002812.SZ	恩捷股份	0.62	-0.35	13.83	10.04	3.79
600900.SH	长江电力	1.18	-0.24	25.49	18.32	7.17
600519.SH	贵州茅台	5.84	2.19	51.97	34.98	16.99
300750.SZ	宁德时代	3.60	0.11	66.78	46.78	20.00

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
600036.SH	招商银行	7.53	2.12	35.74	62.19	-26.46
603501.SH	韦尔股份	2.02	-1.78	6.90	12.79	-5.89
601012.SH	隆基股份	4.66	-4.22	22.87	26.83	-3.96
600048.SH	保利发展	1.40	-0.06	5.55	8.18	-2.63
601318.SH	中国平安	6.82	0.62	12.67	13.74	-1.07
601899.SH	紫金矿业	1.75	0.83	16.87	16.88	-0.01
600887.SH	伊利股份	2.65	0.00	9.92	9.91	0.01
601888.SH	中国中免	2.68	3.01	11.78	11.54	0.25
603259.SH	药明康德	3.04	-2.91	7.83	6.45	1.38
601166.SH	兴业银行	3.46	-1.76	5.62	3.94	1.68
600276.SH	恒瑞医药	2.84	-1.50	4.55	1.97	2.58
601668.SH	中国建筑	1.31	-0.55	12.71	10.01	2.70
600900.SH	长江电力	3.22	-0.45	25.49	18.32	7.17
600519.SH	贵州茅台	16.08	4.07	51.97	34.98	16.99

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
002603.SZ	以岭药业	0.233	-0.9	1.77	4.00	-2.23

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。