

成分股监测报告

2022年5月25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5月16日至5月20日，沪深300指数上涨62.6点。对IF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、农林牧渔、商业贸易；对IF指数周度涨幅提供正贡献排名前三的行业分别为：电气设备、电子、有色金属。上证50指数上涨43.56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、建筑材料、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：电气设备、银行、电子。中证500指数上涨89.25点。对IC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、房地产、银行；对IC指数周度涨幅提供正贡献排名前三的行业分别为：化工、电子、有色金属。

北上资金净流入152.18亿元，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88.3亿元。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，周内北上资金净买入86.47亿元，其中买入408.67亿元，卖出322.21亿元；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61.36亿元，其中买入214.09亿元，卖出152.73亿元；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

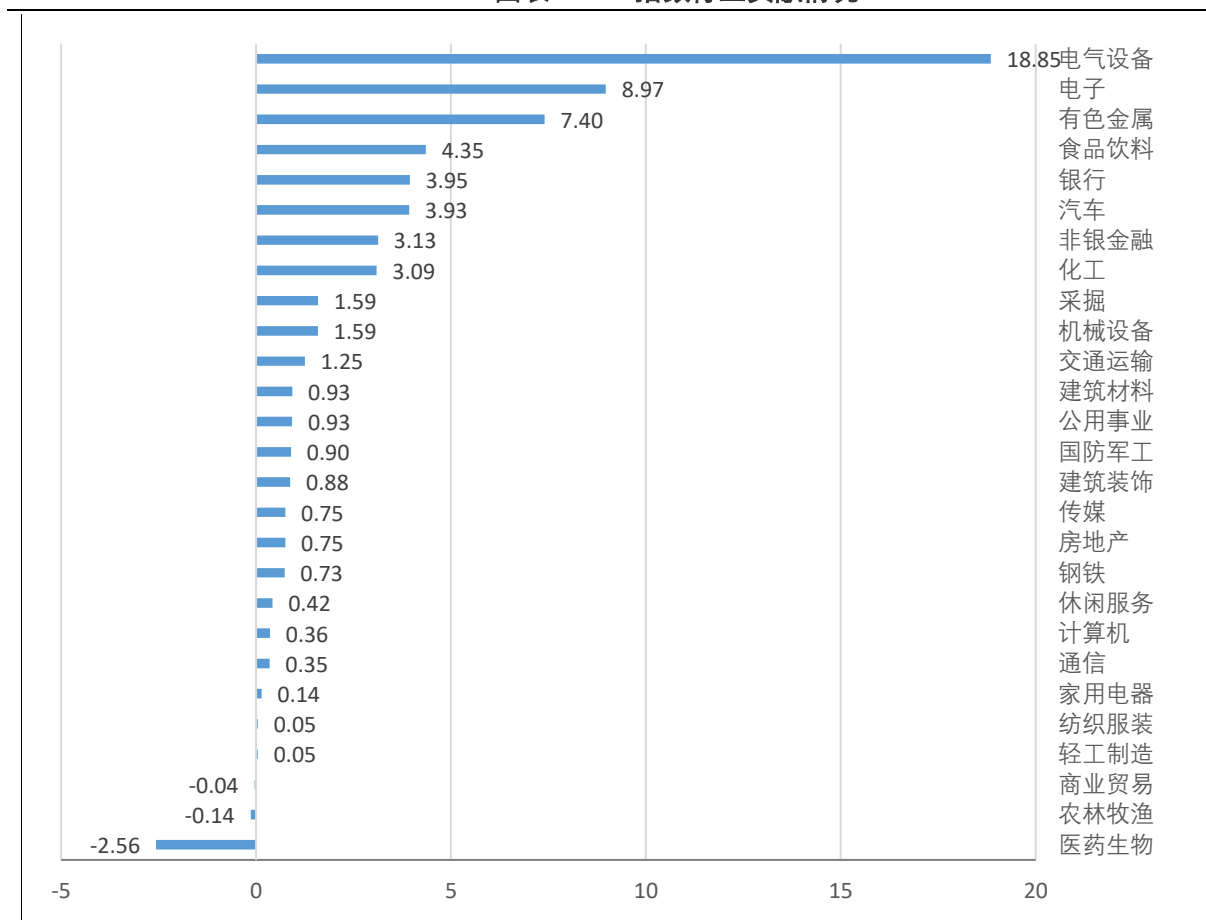
图表目录

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
图表 9: IC 北上资金流入情况.....	错误!未定义书签。

1. 成分股指数拉动情况

2022年5月16日至5月20日，沪深300指数上涨62.6点。在沪深300指数的300只成分股中，有81只股票对指数上涨提供负贡献，有217只股票提供正贡献，有2只股票贡献为0。分行业看，对IF指数周度涨幅提供负贡献排名前三的行业分别为：医药生物、农林牧渔、商业贸易；对IF指数周度涨幅提供正贡献排名前三的行业分别为：电气设备、电子、有色金属。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：沃森生物、智飞生物、药明康德、伊利股份、宁波银行；对指数周度涨幅提供贡献点分别为：-0.95点，-0.76点，-0.73点，-0.62点，-0.52点。对IF指数周度涨幅提供正贡献排名前五的股票分别为：招商银行、隆基绿能、通威股份、宁德时代、比亚迪；对指数周度涨幅提供贡献点分别为：5.7点，4.6点，2.39点，2.38点，2.28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

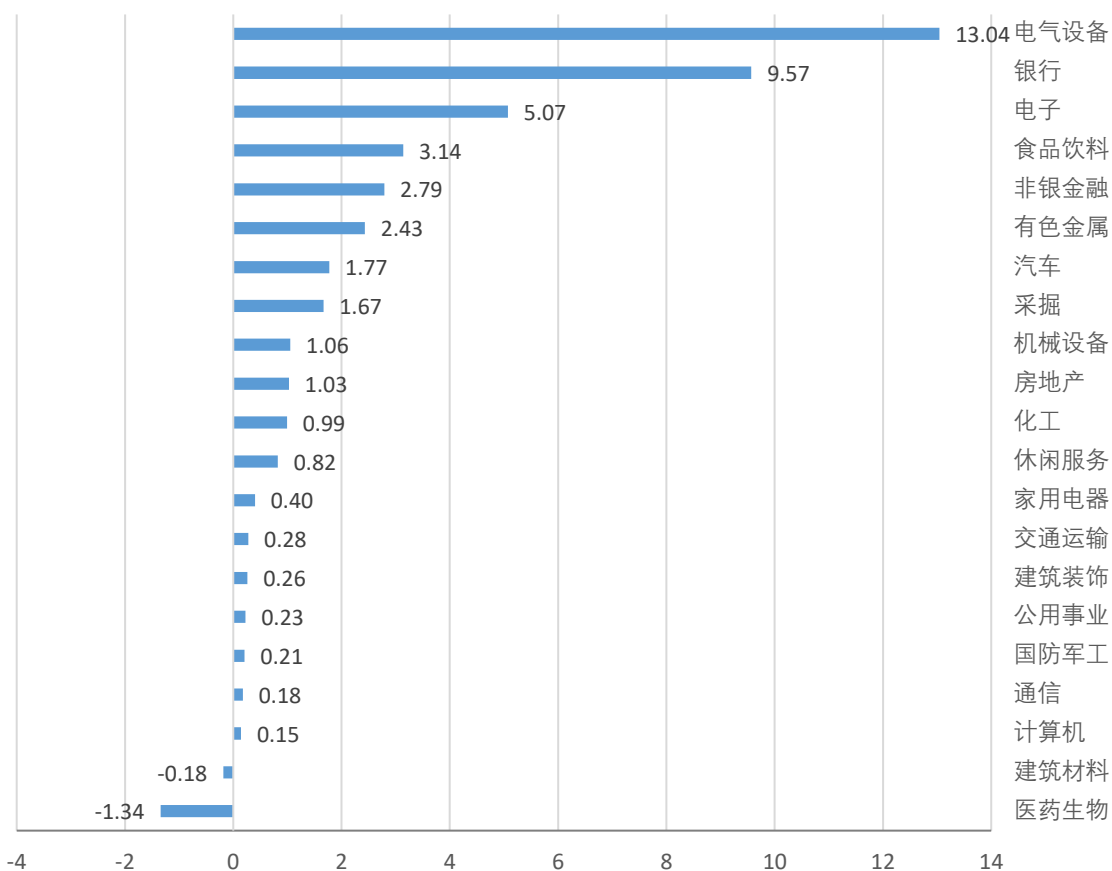
图表 2: IF 指数正/负贡献最大公司

	负贡献		正贡献	
	公司简称	点数	公司简称	点数
1	沃森生物	-0.95	招商银行	5.70
2	智飞生物	-0.76	隆基绿能	4.60
3	药明康德	-0.73	通威股份	2.39
4	伊利股份	-0.62	宁德时代	2.38
5	宁波银行	-0.52	比亚迪	2.28
6	康泰生物	-0.39	贵州茅台	2.19
7	工商银行	-0.38	阳光电源	1.96
8	杭州银行	-0.38	天齐锂业	1.75
9	成都银行	-0.35	五粮液	1.71
10	云南白药	-0.29	赣锋锂业	1.57

数据来源: wind, 兴证期货研发部

2022年5月16日至5月20日, 上证50指数上涨43.56点。在上证50指数的50只成分股中, 有13只股票对指数上涨提供负贡献, 有37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、建筑材料、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: 电气设备、银行、电子。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: 药明康德、伊利股份、工商银行、海天味业、农业银行; 对指数周度涨幅提供贡献点分别为: -1.45点, -1.15点, -0.73点, -0.5点, -0.31点。对IH指数周度涨幅提供正贡献排名前五的股票分别为: 招商银行、隆基绿能、通威股份、贵州茅台、兆易创新; 对指数周度涨幅提供贡献点分别为: 10.9点, 8.51点, 4.53点, 4.1点, 2.43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

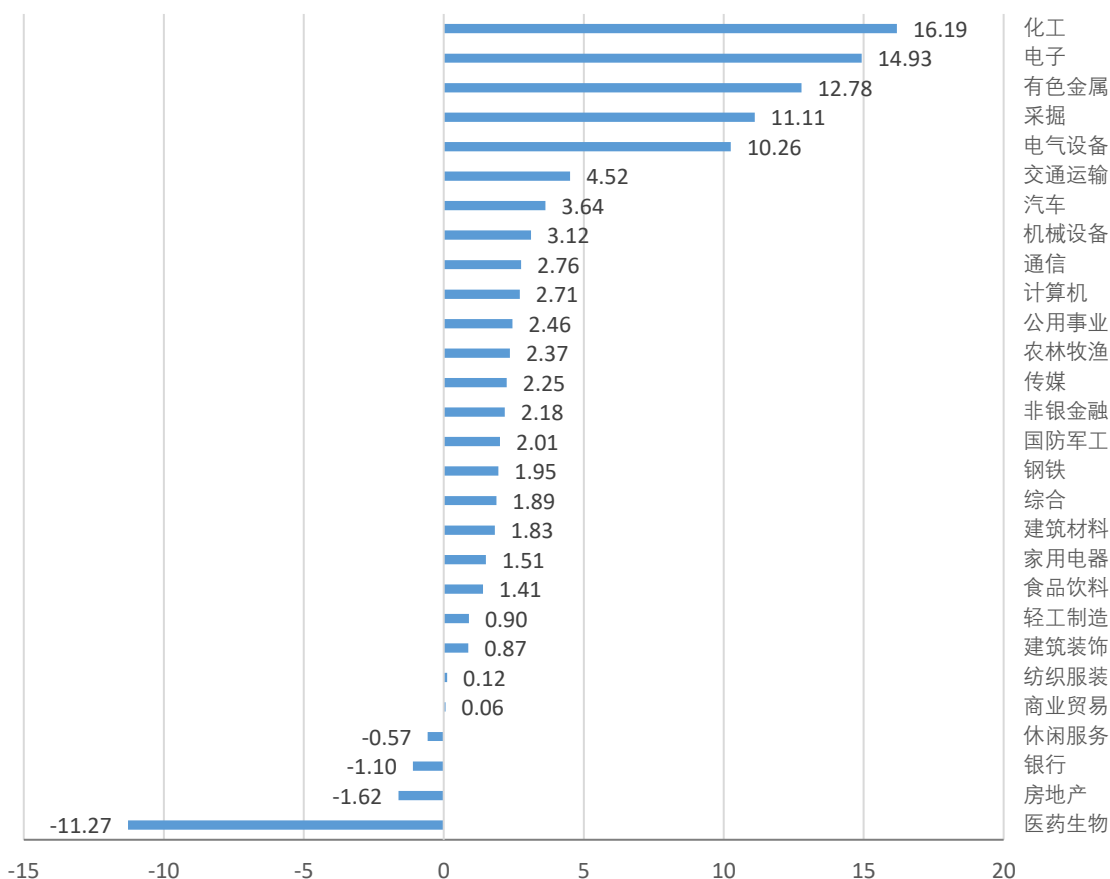
图表 4: IH 指数正/负贡献最大公司

	负贡献		正贡献	
	公司简称	点数	公司简称	点数
1	药明康德	-1.45	招商银行	10.90
2	伊利股份	-1.15	隆基绿能	8.51
3	工商银行	-0.73	通威股份	4.53
4	海天味业	-0.50	贵州茅台	4.10
5	农业银行	-0.31	兆易创新	2.43
6	复星医药	-0.28	紫金矿业	2.39
7	兴业银行	-0.26	韦尔股份	2.06
8	海螺水泥	-0.18	长城汽车	1.51
9	中国人寿	-0.18	中国神华	1.49
10	恒生电子	-0.16	中信证券	1.34

数据来源: wind, 兴证期货研发部

2022年5月16日至5月20日，中证500指数上涨89.25点。在中证500指数的500只成分股中，有136只股票对指数上涨提供负贡献，有355只股票提供正贡献，有9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：医药生物、房地产、银行；对IC指数周度涨幅提供正贡献排名前三的行业分别为：化工、电子、有色金属。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：以岭药业、华润双鹤、博腾股份、金科股份、常熟银行；对指数周度涨幅提供贡献点分别为：-1.6点，-1.42点，-1.29点，-1.13点，-0.82点。对IC指数周度涨幅提供正贡献排名前五的股票分别为：广汇能源、山西焦煤、横店东磁、明阳智能、中天科技；对指数周度涨幅提供贡献点分别为：5.15点，2.88点，2.47点，2.18点，1.68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	以岭药业	-1.60	广汇能源	5.15
2	华润双鹤	-1.42	山西焦煤	2.88
3	博腾股份	-1.29	横店东磁	2.47
4	金科股份	-1.13	明阳智能	2.18
5	常熟银行	-0.82	中天科技	1.68
6	迪安诊断	-0.79	锦浪科技	1.59
7	九州通	-0.68	中国宝安	1.51
8	中国医药	-0.62	江淮汽车	1.46
9	红日药业	-0.60	美锦能源	1.39
10	九洲药业	-0.59	兴发集团	1.39

数据来源: wind, 兴证期货研发部

2. 北上资金个股流向

2022年5月16日至5月20日,北上资金净流入152.18亿元,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88.3亿元。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,周内北上资金净买入86.47亿元,其中买入408.67亿元,卖出322.21亿元;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61.36亿元,其中买入214.09亿元,卖出152.73亿元;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
600036.SH	招商银行	38.9	2.6886	35.17	17.52	17.65
002594.SZ	比亚迪	281	1.248	35.34	26.05	9.29
600900.SH	长江电力	22.89	1.4521	14.60	5.54	9.06
601012.SH	隆基绿能	73.43	1.6551	29.54	21.52	8.02
601166.SH	兴业银行	19.48	1.6414	14.58	6.74	7.84
002352.SZ	顺丰控股	48.31	0.5489	13.43	6.10	7.33
000001.SZ	平安银行	14.4	0.8225	8.57	2.14	6.43
600519.SH	贵州茅台	1760	6.3839	46.82	40.52	6.29
600031.SH	三一重工	15.97	0.546	10.73	4.88	5.86
600438.SH	通威股份	44.96	0.6085	12.55	8.16	4.39
300059.SZ	东方财富	22.08	1.3102	11.46	7.52	3.94
000333.SZ	美的集团	53.79	1.5877	4.76	1.29	3.46
601919.SH	中远海控	14.95	0.5257	4.54	1.18	3.36
300750.SZ	宁德时代	402.04	2.9094	38.09	35.04	3.06
601888.SH	中国中免	164.4	0.9708	10.46	7.44	3.02
002812.SZ	恩捷股份	208.06	0.5933	7.52	5.02	2.51
603501.SH	韦尔股份	157.12	0.4244	7.67	5.66	2.01
000568.SZ	泸州老窖	201.75	0.8509	4.00	2.01	1.99
601318.SH	中国平安	43.14	2.6983	7.39	5.98	1.41
601668.SH	中国建筑	5.6	0.7183	4.43	3.28	1.15
601088.SH	中国神华	32.51	0.559	2.39	1.58	0.81
002714.SZ	牧原股份	48.54	0.7605	2.65	1.87	0.78
002271.SZ	东方雨虹	45.3	0.4567	2.64	1.96	0.69
000625.SZ	长安汽车	14.08	0.2429	2.23	1.76	0.47
002129.SZ	中环股份	42.68	0.4884	2.06	1.83	0.23
300014.SZ	亿纬锂能	75.8	0.413	4.50	4.48	0.02
002460.SZ	赣锋锂业	119.7	0.4828	13.35	13.70	-0.35
000002.SZ	万科A	18.12	0.7318	2.53	2.88	-0.35
002709.SZ	天赐材料	38.86	0.2379	2.20	2.60	-0.40
603259.SH	药明康德	92.25	1.1126	2.00	3.18	-1.18
002371.SZ	北方华创	261.5	0.3417	1.35	2.62	-1.28
002475.SZ	立讯精密	29.06	0.8149	4.31	5.70	-1.38
000858.SZ	五粮液	156.57	1.7347	19.99	21.60	-1.61
002241.SZ	歌尔股份	36.12	0.4642	2.06	3.86	-1.80
601899.SH	紫金矿业	9.71	0.8646	3.92	6.45	-2.53
600887.SH	伊利股份	37.1	1.0969	6.11	8.98	-2.87
600048.SH	保利发展	16.18	0.697	1.18	4.11	-2.93
300274.SZ	阳光电源	77.61	0.366	11.53	19.46	-7.92

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	38.9	7.184	35.17	17.52	17.65
600900.SH	长江电力	22.89	3.755	14.60	5.54	9.06
601012.SH	隆基绿能	73.43	4.277	29.54	21.52	8.02
601166.SH	兴业银行	19.48	4.329	14.58	6.74	7.84
600519.SH	贵州茅台	1760	16.692	46.82	40.52	6.29
600031.SH	三一重工	15.97	1.426	10.73	4.88	5.86
600438.SH	通威股份	44.96	1.613	12.55	8.16	4.39
601919.SH	中远海控	14.95	1.328	4.54	1.18	3.36
601888.SH	中国中免	164.4	2.582	10.46	7.44	3.02
603501.SH	韦尔股份	157.12	1.141	7.67	5.66	2.01
601318.SH	中国平安	43.14	7.016	7.39	5.98	1.41
601668.SH	中国建筑	5.6	1.914	4.43	3.28	1.15
601088.SH	中国神华	32.51	1.476	2.39	1.58	0.81
603259.SH	药明康德	92.25	3.077	2.00	3.18	-1.18
601899.SH	紫金矿业	9.71	2.319	3.92	6.45	-2.53
600887.SH	伊利股份	37.1	2.863	6.11	8.98	-2.87
600048.SH	保利发展	16.18	1.892	1.18	4.11	-2.93

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。