

成分股监测报告

2022年6月1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23日至5月27日，沪深300指数下跌79.67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、食品饮料、医药生物；对IF指数周度跌幅提供正贡献排名前三的行业分别为：采掘、交通运输、汽车。上证50指数下跌50.86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、医药生物、电子；对IH指数周度跌幅提供正贡献排名前三的行业分别为：采掘、交通运输、公用事业。中证500指数下跌41.23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、房地产、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：采掘、国防军工、交通运输。

北上资金净流出95.80亿元，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2.35亿元。在每日前十大活跃股中，沪深300指数300只成分股中有36只股票有北上资金参与，周内北上资金净卖出3.66亿元，其中买入344.68亿元，卖出348.35亿元；上证50指数50只成分股中有18只股票有北上资金参与，周内净买入4.14亿元，其中买入171.89亿元，卖出167.75亿元；中证500指数500只成分股中有1只股票有北上资金参与，周内净买入0.84亿元，其中买入2.23亿元，卖出1.39亿元。

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

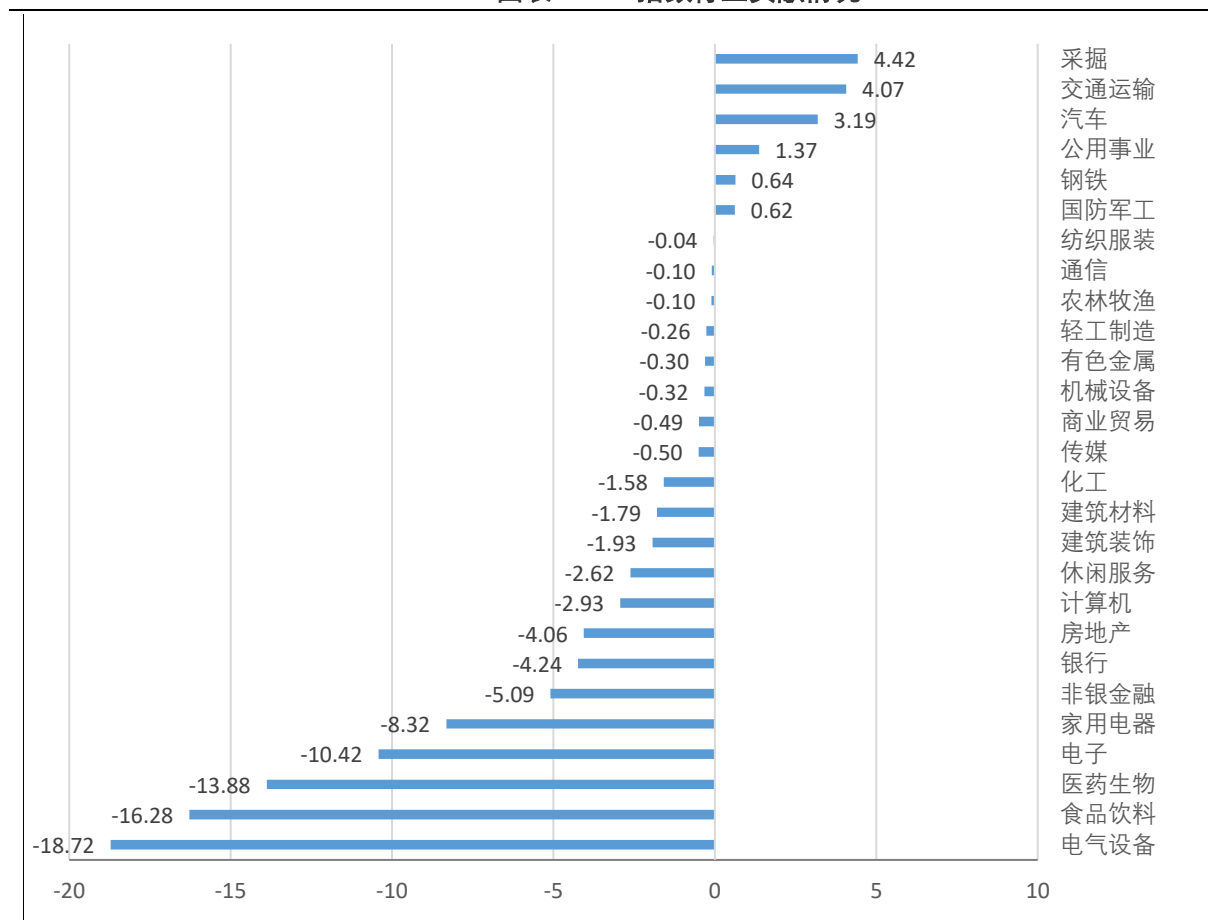
图表目录

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5月23日至5月27日，沪深300指数下跌79.67点。在沪深300指数的300只成分股中，有196只股票对指数下跌提供负贡献，有95只股票提供正贡献，有9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、食品饮料、医药生物；对IF指数周度跌幅提供正贡献排名前三的行业分别为：采掘、交通运输、汽车。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、贵州茅台、美的集团、药明康德、中国中免；对指数周度跌幅提供贡献点分别为：-10.09点，-7.24点，-4.8点，-3.11点，-2.72点。对IF指数周度跌幅提供正贡献排名前五的股票分别为：中国神华、中远海控、陕西煤业、长江电力、天齐锂业；对指数周度跌幅提供贡献点分别为：1.68点，1.5点，1.41点，1.19点，1.18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

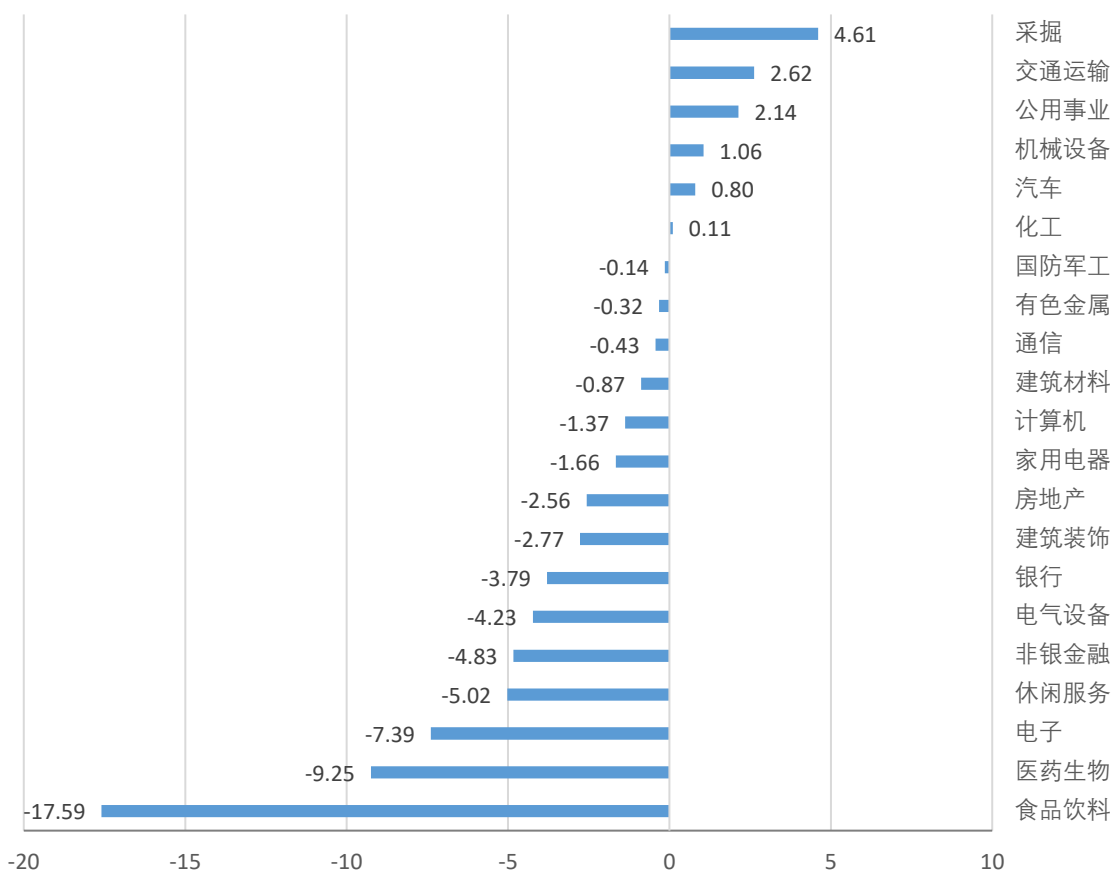
图表 2: IF 指数正/负贡献最大公司

	负贡献		正贡献	
	公司简称	点数	公司简称	点数
1	宁德时代	-10.09	中国神华	1.68
2	贵州茅台	-7.24	中远海控	1.50
3	美的集团	-4.80	陕西煤业	1.41
4	药明康德	-3.11	长江电力	1.19
5	中国中免	-2.72	天齐锂业	1.18
6	招商银行	-2.57	中国石油	0.84
7	五粮液	-2.20	荣盛石化	0.60
8	中国平安	-2.16	中国国航	0.59
9	泸州老窖	-2.15	三一重工	0.58
10	平安银行	-2.09	广汽集团	0.57

数据来源: wind, 兴证期货研发部

2022年5月23日至5月27日, 上证50指数下跌50.86点。在上证50指数的50只成分股中, 有34只股票对指数下跌提供负贡献, 有15只股票提供正贡献, 有1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、医药生物、电子; 对IH指数周度跌幅提供正贡献排名前三的行业分别为: 采掘、交通运输、公用事业。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: 贵州茅台、药明康德、中国中免、招商银行、中国平安; 对指数周度跌幅提供贡献点分别为: -13.16点, -5.97点, -5.02点, -4.78点, -3.91点。对IH指数周度跌幅提供正贡献排名前五的股票分别为: 中国神华、中远海控、长江电力、中国石油、三一重工; 对指数周度跌幅提供贡献点分别为: 3.09点, 2.62点, 2.14点, 1.52点, 1.06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

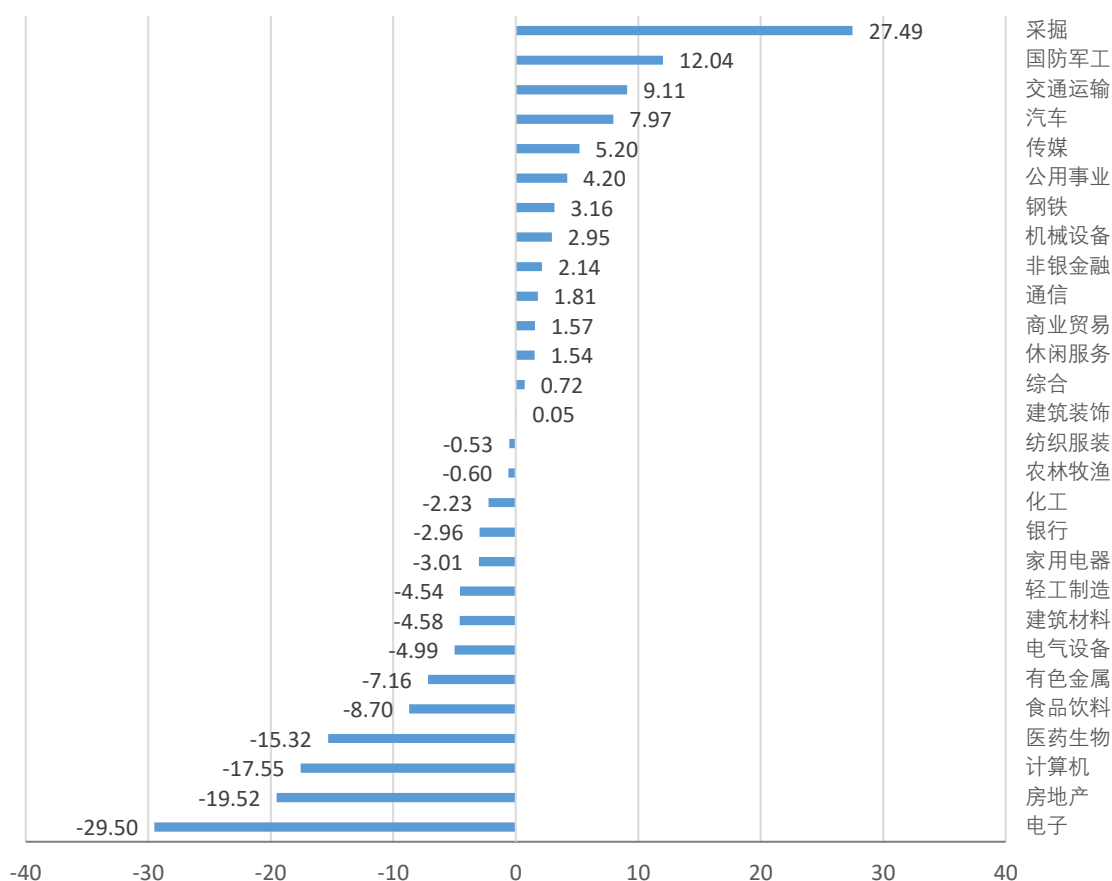
图表 4: IH 指数正/负贡献最大公司

	负贡献		正贡献	
	公司简称	点数	公司简称	点数
1	贵州茅台	-13.16	中国神华	3.09
2	药明康德	-5.97	中远海控	2.62
3	中国中免	-5.02	长江电力	2.14
4	招商银行	-4.78	中国石油	1.52
5	中国平安	-3.91	三一重工	1.06
6	韦尔股份	-3.17	上汽集团	0.67
7	闻泰科技	-3.11	工商银行	0.67
8	中国建筑	-2.77	中国石化	0.56
9	隆基绿能	-2.75	山东黄金	0.34
10	山西汾酒	-2.71	农业银行	0.33

数据来源: wind, 兴证期货研发部

2022年5月23日至5月27日，中证500指数下跌41.23点。在中证500指数的500只成分股中，有284只股票对指数下跌提供负贡献，有200只股票提供正贡献，有16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、房地产、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：采掘、国防军工、交通运输。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、金科股份、纳思达、卫士通、建发股份；对指数周度跌幅提供贡献点分别为：-5.36点，-4.43点，-4.4点，-3.47点，-3.44点。对IC指数周度跌幅提供正贡献排名前五的股票分别为：华润双鹤、杰瑞股份、兖矿能源、广汇能源、中兵红箭；对指数周度跌幅提供贡献点分别为：6.8点，5.48点，5.34点，4.49点，3.93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	-5.36	华润双鹤	6.80
2	金科股份	-4.43	杰瑞股份	5.48
3	纳思达	-4.40	兖矿能源	5.34
4	卫士通	-3.47	广汇能源	4.49
5	建发股份	-3.44	中兵红箭	3.93
6	格林美	-3.42	中航高科	3.92
7	普洛药业	-3.39	山西焦煤	3.72
8	宏发股份	-3.34	中远海能	3.59
9	九洲药业	-3.16	航天发展	3.49
10	锡业股份	-3.07	山煤国际	3.47

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23日至5月27日,北上资金净流出95.80亿元,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2.35亿元。在每日前十大活跃股中,沪深300指数300只成分股中有36只股票有北上资金参与,周内北上资金净卖出3.66亿元,其中买入344.68亿元,卖出348.35亿元;上证50指数50只成分股中有18只股票有北上资金参与,周内净买入4.14亿元,其中买入171.89亿元,卖出167.75亿元;中证500指数500只成分股中有1只股票有北上资金参与,周内净买入0.84亿元,其中买入2.23亿元,卖出1.39亿元。

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	38.9	2.6886	26.16	19.28	6.88
600900.SH	长江电力	22.89	1.4521	13.93	7.23	6.70
601919.SH	中远海控	14.95	0.5257	13.25	6.61	6.64
002352.SZ	顺丰控股	48.31	0.5489	10.61	5.18	5.43
600887.SH	伊利股份	37.1	1.0969	12.83	8.21	4.62
300014.SZ	亿纬锂能	75.8	0.413	7.36	3.13	4.23
300760.SZ	迈瑞医疗	290.5	0.8528	8.65	4.54	4.12
600438.SH	通威股份	44.96	0.6085	6.07	3.44	2.63
600031.SH	三一重工	15.97	0.546	5.41	2.92	2.49
002475.SZ	立讯精密	29.06	0.8149	7.72	5.32	2.40
603259.SH	药明康德	92.25	1.1126	11.58	9.26	2.32
601225.SH	陕西煤业	18.15	0.3605	3.75	1.85	1.90
300124.SZ	汇川技术	59.19	0.5932	3.06	1.97	1.09
601088.SH	中国神华	32.51	0.559	2.70	1.81	0.89
300274.SZ	阳光电源	77.61	0.366	8.22	7.39	0.83
002594.SZ	比亚迪	281	1.248	33.14	32.42	0.72
601668.SH	中国建筑	5.6	0.7183	2.30	2.58	-0.28
600048.SH	保利发展	16.18	0.697	2.09	2.57	-0.48
600809.SH	山西汾酒	252.04	0.7211	1.36	2.34	-0.98
601318.SH	中国平安	43.14	2.6983	1.78	2.80	-1.03
300059.SZ	东方财富	22.08	1.3102	10.96	12.23	-1.27
000651.SZ	格力电器	31.79	0.8959	1.57	2.87	-1.30
000333.SZ	美的集团	53.79	1.5877	5.41	6.82	-1.41
002812.SZ	恩捷股份	208.06	0.5933	2.31	3.79	-1.47
300750.SZ	宁德时代	402.04	2.9094	40.70	42.38	-1.68
601888.SH	中国中免	164.4	0.9708	5.22	7.15	-1.92
002709.SZ	天赐材料	38.86	0.2379	0.90	2.88	-1.97
002027.SZ	分众传媒	5.48	0.3295	1.08	3.27	-2.20
000568.SZ	泸州老窖	201.75	0.8509	1.37	3.65	-2.28
600585.SH	海螺水泥	36.92	0.5362	2.09	4.45	-2.36
601012.SH	隆基绿能	73.43	1.6551	17.56	20.44	-2.88
603501.SH	韦尔股份	157.12	0.4244	4.42	8.04	-3.62
002460.SZ	赣锋锂业	119.7	0.4828	12.05	16.13	-4.08
600276.SH	恒瑞医药	28.61	0.7352	8.30	12.98	-4.68
600519.SH	贵州茅台	1760	6.3839	34.84	45.65	-10.81
000858.SZ	五粮液	156.57	1.7347	13.93	24.80	-10.87

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	26.16	19.28	6.88
600900.SH	长江电力	22.89	3.755	13.93	7.23	6.70
601919.SH	中远海控	14.95	1.328	13.25	6.61	6.64
600887.SH	伊利股份	37.1	2.863	12.83	8.21	4.62
600438.SH	通威股份	44.96	1.613	6.07	3.44	2.63
600031.SH	三一重工	15.97	1.426	5.41	2.92	2.49
603259.SH	药明康德	92.25	3.077	11.58	9.26	2.32
601088.SH	中国神华	32.51	1.476	2.70	1.81	0.89
601668.SH	中国建筑	5.6	1.914	2.30	2.58	-0.28
600048.SH	保利发展	16.18	1.892	2.09	2.57	-0.48
600809.SH	山西汾酒	252.04	1.929	1.36	2.34	-0.98
601318.SH	中国平安	43.14	7.016	1.78	2.80	-1.03
601888.SH	中国中免	164.4	2.582	5.22	7.15	-1.92
600585.SH	海螺水泥	36.92	1.394	2.09	4.45	-2.36
601012.SH	隆基绿能	73.43	4.277	17.56	20.44	-2.88
603501.SH	韦尔股份	157.12	1.141	4.42	8.04	-3.62
600276.SH	恒瑞医药	28.61	1.918	8.30	12.98	-4.68
600519.SH	贵州茅台	1760	16.692	34.84	45.65	-10.81

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
603290.SH	斯达半导	377.65	0.328	2.23	1.39	0.84

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。