

成分股监测报告

2022年6月8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30日至6月4日，沪深300指数上涨68.71点。对IF指数周度涨幅提供负贡献排名前三的行业分别为：银行、房地产、建筑装饰；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、食品饮料。上证50指数上涨12.47点。对IH指数周度涨幅提供负贡献排名前三的行业分别为：银行、房地产、采掘；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、食品饮料、电子。中证500指数上涨160.19点。对IC指数周度涨幅提供负贡献排名前三的行业分别为：房地产、采掘、医药生物；对IC指数周度涨幅提供正贡献排名前三的行业分别为：电子、电气设备、计算机。

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79.68亿元。在每日前十大活跃股中，沪深300指数300只成分股中有33只股票有北上资金参与，周内北上资金净买入72.73亿元，其中买入372.96亿元，卖出300.23亿元；上证50指数50只成分股中有16只股票有北上资金参与，周内净买入34.14亿元，其中买入179.28亿元，卖出145.14亿元；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1.94亿元，其中买入3.42亿元，卖出1.48亿元。

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

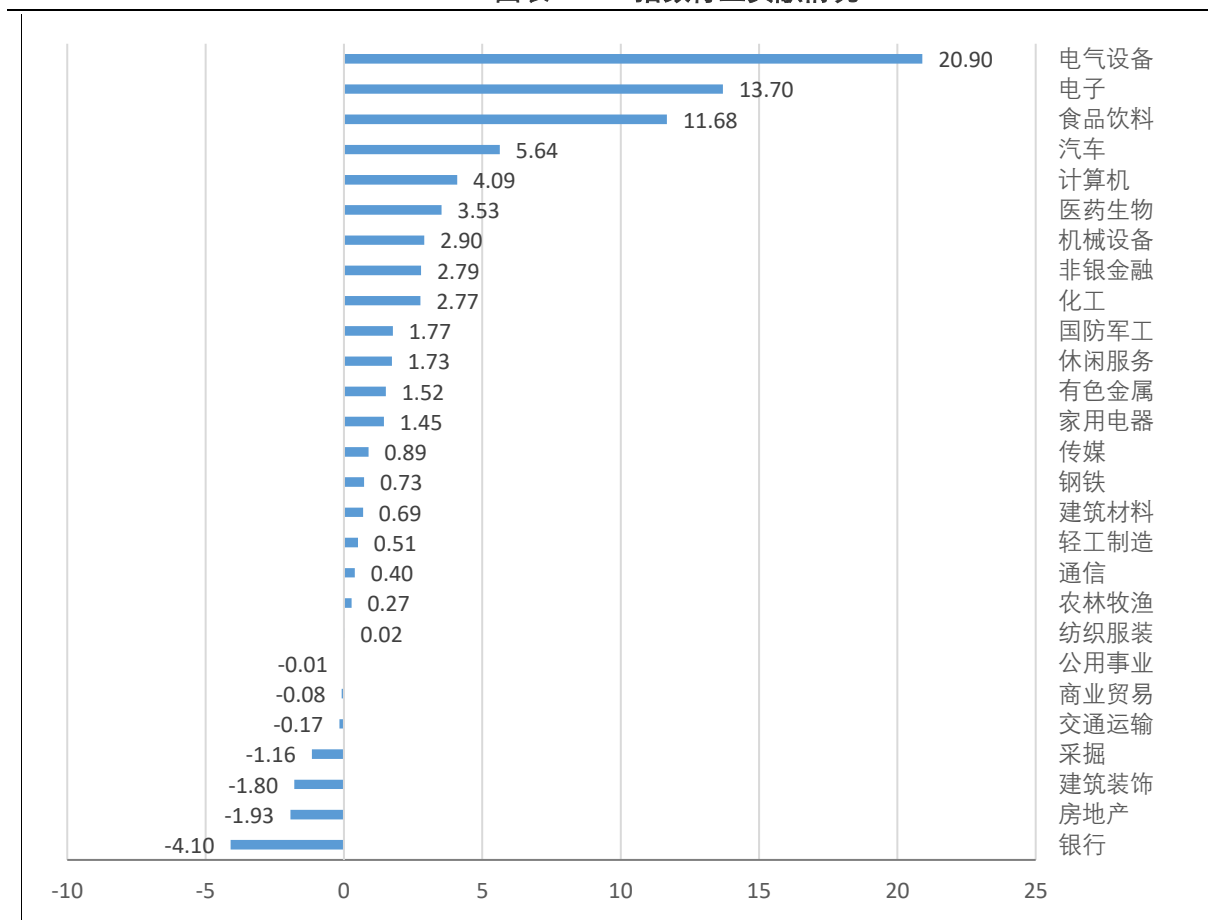
图表目录

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30日至6月4日，沪深300指数上涨68.71点。在沪深300指数的300只成分股中，有95只股票对指数上涨提供负贡献，有205只股票提供正贡献，有0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：银行、房地产、建筑装饰；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、食品饮料。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：保利发展、兴业银行、中国神华、中国中铁、中国建筑；对指数周度涨幅提供贡献点分别为：-1.04点，-0.79点，-0.62点，-0.61点，-0.58点。对IF指数周度涨幅提供正贡献排名前五的股票分别为：宁德时代、五粮液、隆基绿能、贵州茅台、亿纬锂能；对指数周度涨幅提供贡献点分别为：9.47点，3.66点，3.27点，2.92点，2.06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

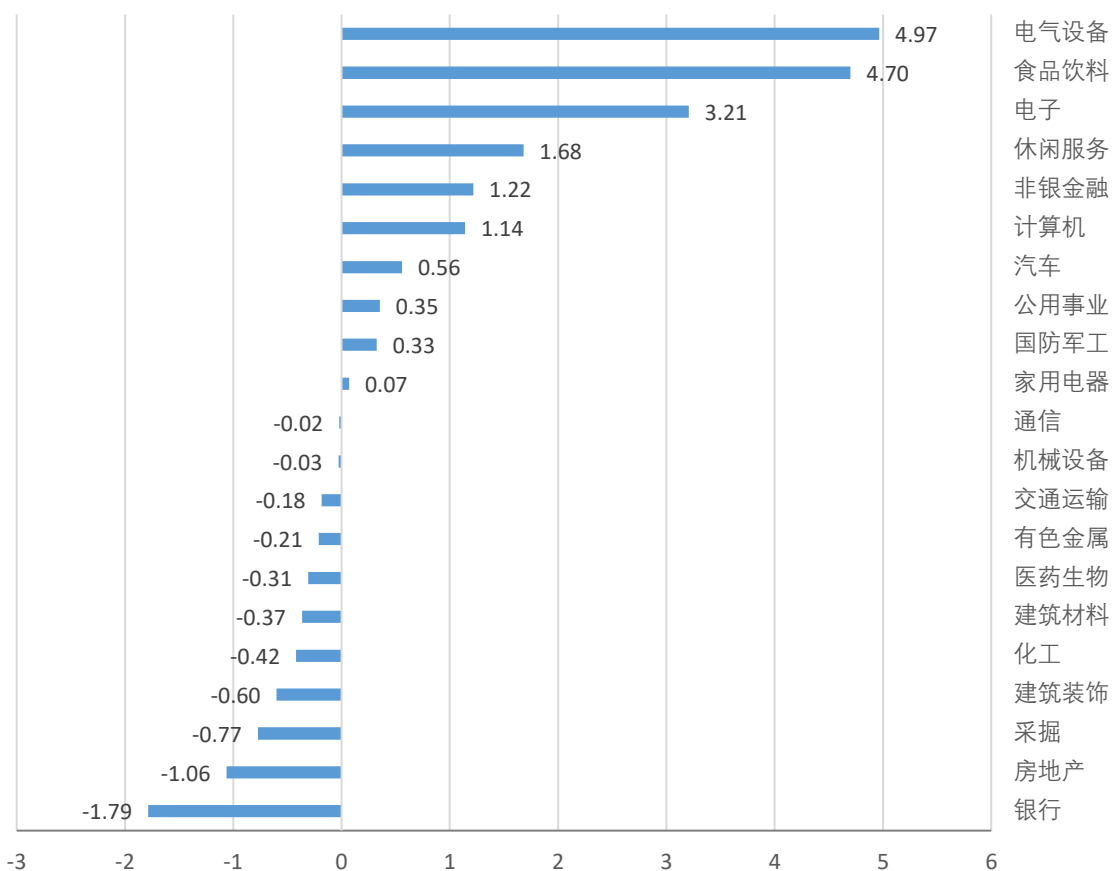
图表 2: IF 指数正/负贡献最大公司

	负贡献		正贡献	
	公司简称	点数	公司简称	点数
1	保利发展	-1.04	宁德时代	9.47
2	兴业银行	-0.79	五粮液	3.66
3	中国神华	-0.62	隆基绿能	3.27
4	中国中铁	-0.61	贵州茅台	2.92
5	中国建筑	-0.58	亿纬锂能	2.06
6	药明康德	-0.57	韦尔股份	1.93
7	双汇发展	-0.51	立讯精密	1.88
8	万科A	-0.43	比亚迪	1.69
9	万华化学	-0.42	中国中免	1.61
10	招商银行	-0.37	华友钴业	1.57

数据来源: wind, 兴证期货研发部

2022年5月30日至6月4日, 上证50指数上涨12.47点。在上证50指数的50只成分股中, 有21只股票对指数上涨提供负贡献, 有29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: 银行、房地产、采掘; 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、食品饮料、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: 保利发展、兴业银行、中国神华、中国建筑、药明康德; 对指数周度涨幅提供贡献点分别为: -1.06点, -0.83点, -0.65点, -0.6点, -0.6点。对IH指数周度涨幅提供正贡献排名前五的股票分别为: 隆基绿能、贵州茅台、韦尔股份、中国中免、通威股份; 对指数周度涨幅提供贡献点分别为: 3.42点, 3.06点, 2.02点, 1.68点, 1.55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

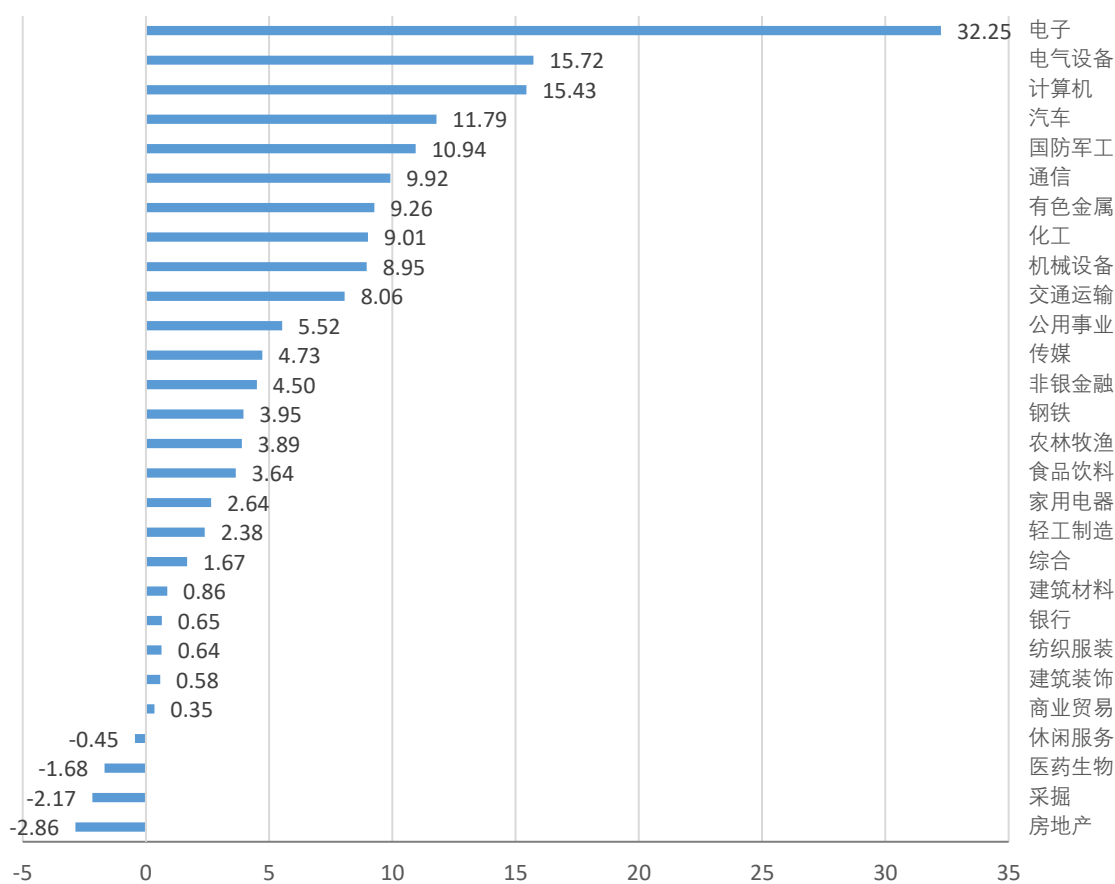
图表 4: IH 指数正/负贡献最大公司

	负贡献		正贡献	
	公司简称	点数	公司简称	点数
1	保利发展	-1.06	隆基绿能	3.42
2	兴业银行	-0.83	贵州茅台	3.06
3	中国神华	-0.65	韦尔股份	2.02
4	中国建筑	-0.60	中国中免	1.68
5	药明康德	-0.60	通威股份	1.55
6	万华化学	-0.44	山西汾酒	1.55
7	伊利股份	-0.39	恒生电子	0.83
8	招商银行	-0.39	中国平安	0.80
9	海螺水泥	-0.37	兆易创新	0.61
10	工商银行	-0.22	海天味业	0.48

数据来源: wind, 兴证期货研发部

2022年5月30日至6月4日，中证500指数上涨160.19点。在中证500指数的500只成分股中，有104只股票对指数上涨提供负贡献，有387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：房地产、采掘、医药生物；对IC指数周度涨幅提供正贡献排名前三的行业分别为：电子、电气设备、计算机。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：华润双鹤、广汇能源、赤峰黄金、九洲药业、山西焦煤；对指数周度涨幅提供贡献点分别为：-4.02点，-3.47点，-1点，-0.87点，-0.85点。对IC指数周度涨幅提供正贡献排名前五的股票分别为：中天科技、思源电气、容百科技、格林美、雅克科技；对指数周度涨幅提供贡献点分别为：3.52点，3.2点，3.05点，2.81点，2.77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	华润双鹤	-4.02	中天科技	3.52
2	广汇能源	-3.47	思源电气	3.20
3	赤峰黄金	-1.00	容百科技	3.05
4	九洲药业	-0.87	格林美	2.81
5	山西焦煤	-0.85	雅克科技	2.77
6	兖矿能源	-0.65	爱旭股份	2.64
7	信达地产	-0.60	北汽蓝谷	2.31
8	以岭药业	-0.59	东山精密	2.24
9	中国医药	-0.56	怡亚通	2.07
10	建发股份	-0.56	亨通光电	2.00

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30日至6月4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79.68亿元。在每日前十大活跃股中,沪深300指数300只成分股中有33只股票有北上资金参与,周内北上资金净买入72.73亿元,其中买入372.96亿元,卖出300.23亿元;上证50指数50只成分股中有16只股票有北上资金参与,周内净买入34.14亿元,其中买入179.28亿元,卖出145.14亿元;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1.94亿元,其中买入3.42亿元,卖出1.48亿元。

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
000858.SZ	五粮液	156.57	1.7347	33.67	19.35	14.32
600519.SH	贵州茅台	1760	6.3839	44.29	31.09	13.20
300059.SZ	东方财富	22.08	1.3102	20.24	8.33	11.91
600036.SH	招商银行	38.9	2.6886	21.12	9.24	11.88
601888.SH	中国中免	164.4	0.9708	20.47	10.49	9.99
000568.SZ	泸州老窖	201.75	0.8509	10.44	3.98	6.46
300750.SZ	宁德时代	402.04	2.9094	38.80	32.41	6.39
601012.SH	隆基绿能	73.43	1.6551	23.34	20.33	3.01
300760.SZ	迈瑞医疗	290.5	0.8528	4.43	1.59	2.84
601318.SH	中国平安	43.14	2.6983	10.25	7.81	2.44
002027.SZ	分众传媒	5.48	0.3295	3.72	1.68	2.04
300274.SZ	阳光电源	77.61	0.366	10.80	8.96	1.84
600809.SH	山西汾酒	252.04	0.7211	3.23	1.52	1.71
002812.SZ	恩捷股份	208.06	0.5933	3.37	1.75	1.62
603259.SH	药明康德	92.25	1.1126	12.49	10.97	1.51
000625.SZ	长安汽车	14.08	0.2429	3.42	1.96	1.46
600438.SH	通威股份	44.96	0.6085	8.09	6.69	1.40
000333.SZ	美的集团	53.79	1.5877	4.06	2.69	1.37
002241.SZ	歌尔股份	36.12	0.4642	7.44	6.41	1.04
600887.SH	伊利股份	37.1	1.0969	11.26	10.25	1.01
601166.SH	兴业银行	19.48	1.6414	4.11	3.35	0.76
002371.SZ	北方华创	261.5	0.3417	2.49	2.73	-0.25
600406.SH	国电南瑞	32.48	0.4809	6.52	6.99	-0.47
601668.SH	中国建筑	5.6	0.7183	2.08	2.69	-0.61
002460.SZ	赣锋锂业	119.7	0.4828	5.00	6.27	-1.27
601899.SH	紫金矿业	9.71	0.8646	1.74	3.01	-1.28
603501.SH	韦尔股份	157.12	0.4244	7.35	8.72	-1.37
600048.SH	保利发展	16.18	0.697	2.50	4.62	-2.11
000651.SZ	格力电器	31.79	0.8959	1.44	3.85	-2.41
002475.SZ	立讯精密	29.06	0.8149	14.87	17.49	-2.61
600900.SH	长江电力	22.89	1.4521	6.46	9.84	-3.38
600585.SH	海螺水泥	36.92	0.5362	0.50	4.52	-4.02
002594.SZ	比亚迪	281	1.248	22.97	28.65	-5.69

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	1760	16.692	44.29	31.09	13.20
600036.SH	招商银行	38.9	7.184	21.12	9.24	11.88
601888.SH	中国中免	164.4	2.582	20.47	10.49	9.99
601012.SH	隆基绿能	73.43	4.277	23.34	20.33	3.01
601318.SH	中国平安	43.14	7.016	10.25	7.81	2.44
600809.SH	山西汾酒	252.04	1.929	3.23	1.52	1.71
603259.SH	药明康德	92.25	3.077	12.49	10.97	1.51
600438.SH	通威股份	44.96	1.613	8.09	6.69	1.40
600887.SH	伊利股份	37.1	2.863	11.26	10.25	1.01
601166.SH	兴业银行	19.48	4.329	4.11	3.35	0.76
601668.SH	中国建筑	5.6	1.914	2.08	2.69	-0.61
601899.SH	紫金矿业	9.71	2.319	1.74	3.01	-1.28
603501.SH	韦尔股份	157.12	1.141	7.35	8.72	-1.37
600048.SH	保利发展	16.18	1.892	2.50	4.62	-2.11
600900.SH	长江电力	22.89	3.755	6.46	9.84	-3.38
600585.SH	海螺水泥	36.92	1.394	0.50	4.52	-4.02

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
600233.SH	圆通速递	18.86	0.457	3.42	1.48	1.94

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。