

成分股监测报告

2022年6月15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6月6日至6月10日，沪深300指数上涨148.47点。对IF指数周度涨幅提供负贡献排名前三的行业分别为：家用电器、建筑材料、轻工制造；对IF指数周度涨幅提供正贡献排名前三的行业分别为：食品饮料、非银金融、电气设备。上证50指数上涨107.14点。对IH指数周度涨幅提供负贡献排名前三的行业分别为：电子、家用电器、交通运输；对IH指数周度涨幅提供正贡献排名前三的行业分别为：食品饮料、电气设备、医药生物。中证500指数上涨160.22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。

北上资金净流入368.30亿元，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140.25亿元。在每日前十大活跃股中，沪深300指数300只成分股中有34只股票有北上资金参与，周内北上资金净买入162.49亿元，其中买入611.67亿元，卖出449.18亿元；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144.55亿元，其中买入344.35亿元，卖出199.8亿元；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

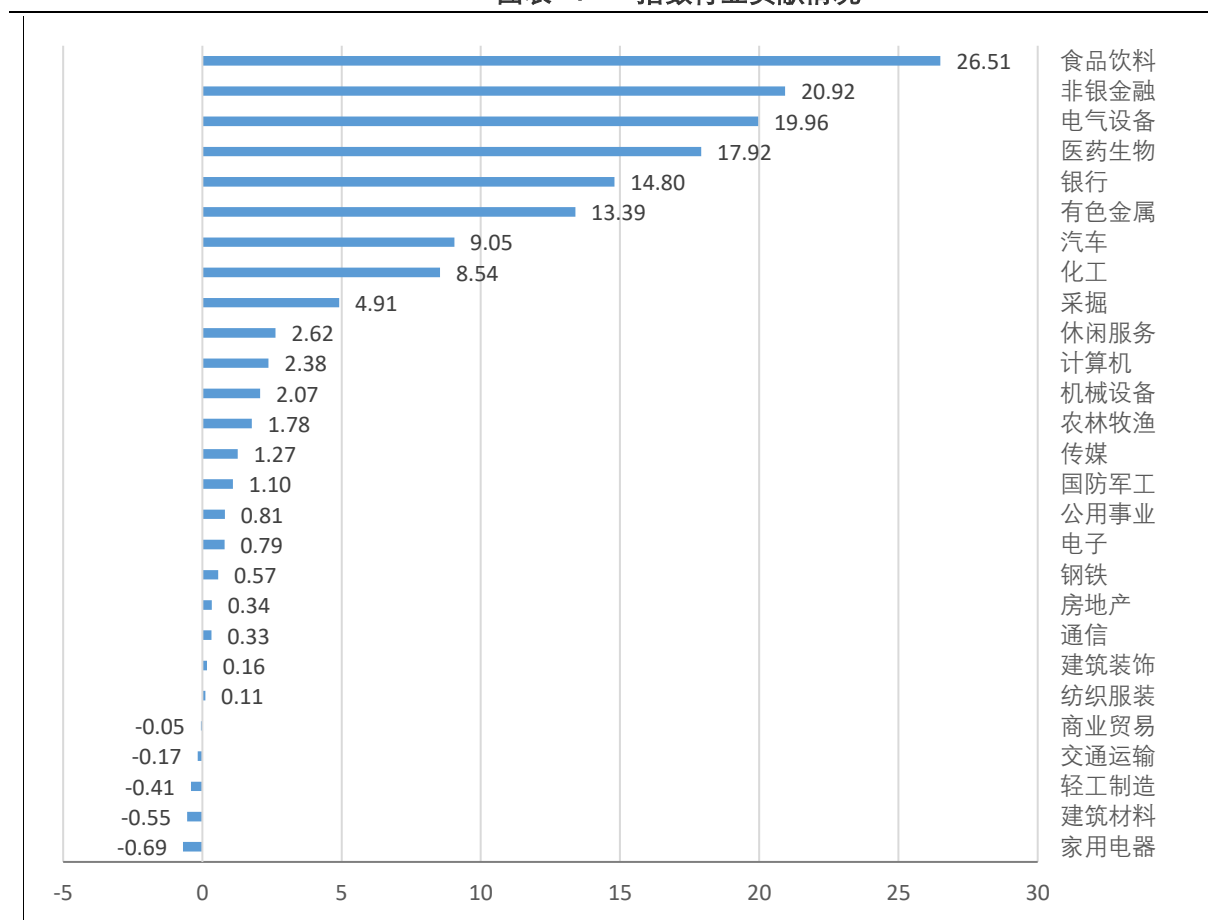
图表目录

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

1. 成分股指数拉动情况

2022年6月6日至6月10日，沪深300指数上涨148.47点。在沪深300指数的300只成分股中，有74只股票对指数上涨提供负贡献，有226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：家用电器、建筑材料、轻工制造；对IF指数周度涨幅提供正贡献排名前三的行业分别为：食品饮料、非银金融、电气设备。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：海尔智家、兆易创新、国电南瑞、北方华创、歌尔股份；对指数周度涨幅提供贡献点分别为：-1点，-0.94点，-0.92点，-0.89点，-0.74点。对IF指数周度涨幅提供正贡献排名前五的股票分别为：贵州茅台、比亚迪、药明康德、隆基绿能、宁德时代；对指数周度涨幅提供贡献点分别为：15.41点，9.23点，5.74点，5.27点，5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

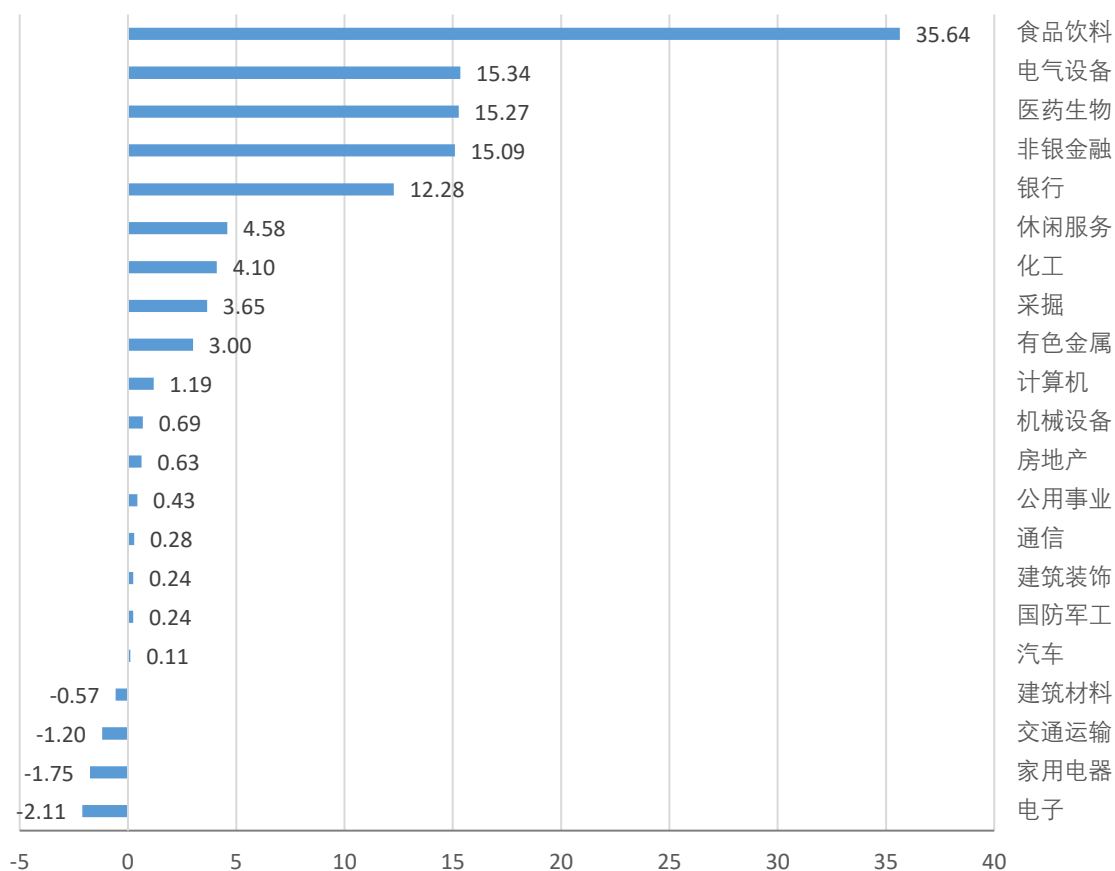
图表 2: IF 指数正/负贡献最大公司

	负贡献		正贡献	
	公司简称	点数	公司简称	点数
1	海尔智家	-1.00	贵州茅台	15.41
2	兆易创新	-0.94	比亚迪	9.23
3	国电南瑞	-0.92	药明康德	5.74
4	北方华创	-0.89	隆基绿能	5.27
5	歌尔股份	-0.74	宁德时代	5.00
6	韦尔股份	-0.72	天齐锂业	3.83
7	中远海控	-0.68	通威股份	3.38
8	华能国际	-0.63	招商银行	3.24
9	沃森生物	-0.58	五粮液	3.20
10	中国中铁	-0.37	东方财富	3.17

数据来源: wind, 兴证期货研发部

2022 年 6 月 6 日至 6 月 10 日, 上证 50 指数上涨 107.14 点。在上证 50 指数的 50 只成分股中, 有 6 只股票对指数上涨提供负贡献, 有 44 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: 电子、家用电器、交通运输; 对 IH 指数周度涨幅提供正贡献排名前三的行业分别为: 食品饮料、电气设备、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: 海尔智家、兆易创新、韦尔股份、中远海控、海螺水泥; 对指数周度涨幅提供贡献点分别为: -1.75 点, -1.66 点, -1.28 点, -1.2 点, -0.57 点。对 IH 指数周度涨幅提供正贡献排名前五的股票分别为: 贵州茅台、药明康德、隆基绿能、通威股份、招商银行; 对指数周度涨幅提供贡献点分别为: 27.41 点, 10.33 点, 9.36 点, 5.98 点, 5.71 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

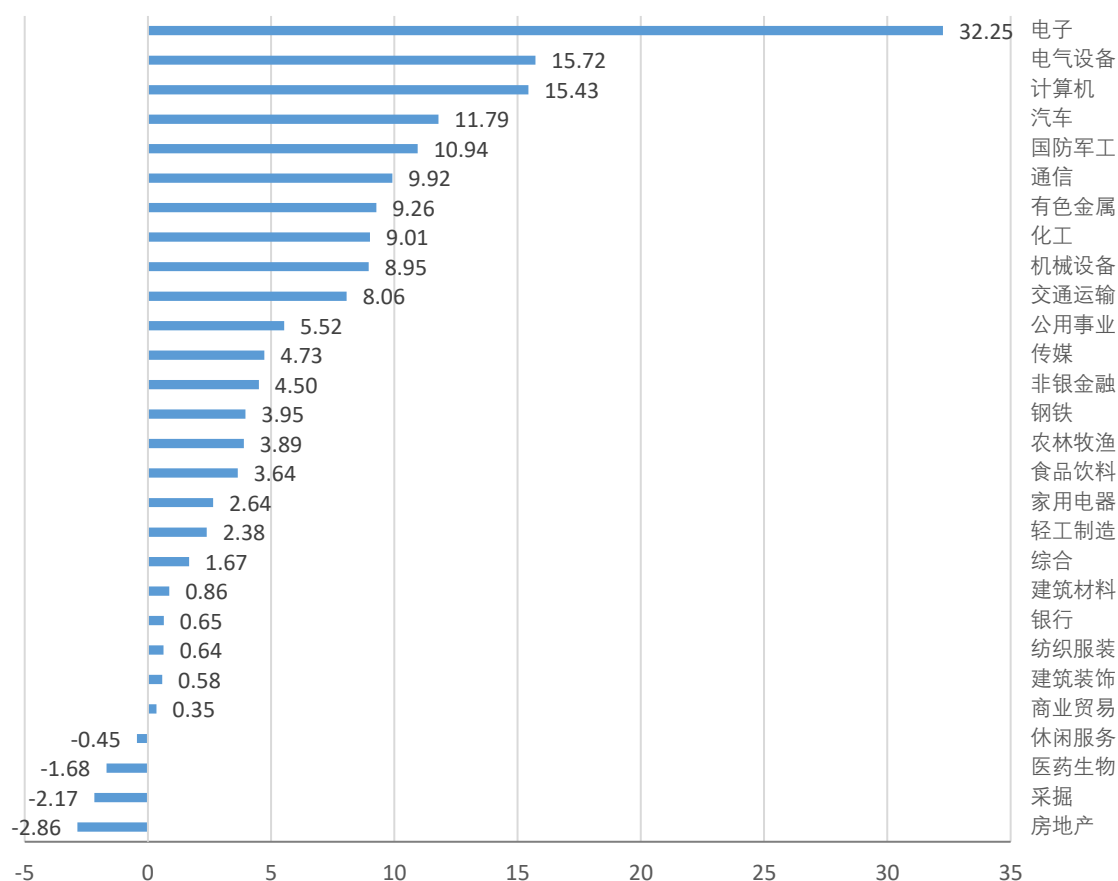
图表 4: IH 指数正/负贡献最大公司

	负贡献		正贡献	
	公司简称	点数	公司简称	点数
1	海尔智家	-1.75	贵州茅台	27.41
2	兆易创新	-1.66	药明康德	10.33
3	韦尔股份	-1.28	隆基绿能	9.36
4	中远海控	-1.20	通威股份	5.98
5	海螺水泥	-0.57	招商银行	5.71
6	上汽集团	-0.34	兴业银行	5.46
7	用友网络	0.04	中国中免	4.58
8	中国电信	0.07	中信证券	4.12
9	复星医药	0.08	中国平安	3.86
10	山东黄金	0.11	万华化学	3.49

数据来源: wind, 兴证期货研发部

2022年6月6日至6月10日，中证500指数上涨160.22点。在中证500指数的500只成分股中，有179只股票对指数上涨提供负贡献，有313只股票提供正贡献，有8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：斯达半导、怡亚通、思源电气、中天科技、思瑞浦；对指数周度涨幅提供贡献点分别为：-2.32点，-1.98点，-1.73点，-1.47点，-1.21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、山煤国际、山西焦煤、兴发集团、博腾股份；对指数周度涨幅提供贡献点分别为：10.6点，5.48点，4.61点，4.25点，3.96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	斯达半导	-2.32	广汇能源	10.60
2	怡亚通	-1.98	山煤国际	5.48
3	思源电气	-1.73	山西焦煤	4.61
4	中天科技	-1.47	兴发集团	4.25
5	思瑞浦	-1.21	博腾股份	3.96
6	招商轮船	-0.94	兖矿能源	3.64
7	金科股份	-0.91	捷佳伟创	3.51
8	北汽蓝谷	-0.90	中国软件	3.20
9	福田汽车	-0.87	铜陵有色	3.19
10	索菲亚	-0.83	驰宏锌锗	3.14

数据来源: wind, 兴证期货研发部

2. 北上资金个股流向

2022 年 6 月 6 日至 6 月 10 日, 北上资金净流入 368.30 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 140.25 亿元。在每日前十大活跃股中, 沪深 300 指数 300 只成分股中有 34 只股票有北上资金参与, 周内北上资金净买入 162.49 亿元, 其中买入 611.67 亿元, 卖出 449.18 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 144.55 亿元, 其中买入 344.35 亿元, 卖出 199.8 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
600519.SH	贵州茅台	1760	6.3839	98.44	37.75	60.68
600887.SH	伊利股份	37.1	1.0969	37.50	10.89	26.62
601888.SH	中国中免	164.4	0.9708	43.46	21.17	22.29
601012.SH	隆基绿能	73.43	1.6551	36.48	23.01	13.48
603259.SH	药明康德	92.25	1.1126	22.80	13.34	9.46
002594.SZ	比亚迪	281	1.248	42.12	33.52	8.60
600438.SH	通威股份	44.96	0.6085	27.74	20.04	7.71
601899.SH	紫金矿业	9.71	0.8646	8.03	1.44	6.58
300059.SZ	东方财富	22.08	1.3102	33.47	27.56	5.92
600690.SH	海尔智家	24.83	0.5548	5.42	0.96	4.47
601166.SH	兴业银行	19.48	1.6414	6.66	2.48	4.18
002049.SZ	紫光国微	179	0.4467	6.35	2.20	4.16
600031.SH	三一重工	15.97	0.546	5.81	2.10	3.71
000858.SZ	五粮液	156.57	1.7347	31.53	28.67	2.86
002460.SZ	赣锋锂业	119.7	0.4828	17.31	14.67	2.64
600036.SH	招商银行	38.9	2.6886	23.23	20.73	2.49
300450.SZ	先导智能	46.6	0.2708	4.68	2.31	2.38
300347.SZ	泰格医药	81.6	0.2552	11.21	9.48	1.73
002241.SZ	歌尔股份	36.12	0.4642	7.43	5.86	1.57
300014.SZ	亿纬锂能	75.8	0.413	3.85	2.64	1.21
002271.SZ	东方雨虹	45.3	0.4567	3.90	2.81	1.09
300124.SZ	汇川技术	59.19	0.5932	3.08	2.19	0.89
000333.SZ	美的集团	53.79	1.5877	7.29	6.60	0.69
002142.SZ	宁波银行	32.98	0.7971	3.18	2.90	0.28
603501.SH	韦尔股份	157.12	0.4244	6.63	7.22	-0.59
601318.SH	中国平安	43.14	2.6983	5.92	7.02	-1.11
002475.SZ	立讯精密	29.06	0.8149	18.46	19.62	-1.16
600111.SH	北方稀土	34.13	0.3818	3.39	4.86	-1.47
600276.SH	恒瑞医药	28.61	0.7352	3.31	5.21	-1.90
300274.SZ	阳光电源	77.61	0.366	13.44	15.43	-1.99
000002.SZ	万科A	18.12	0.7318	1.30	5.43	-4.13
600900.SH	长江电力	22.89	1.4521	8.58	13.03	-4.45
300750.SZ	宁德时代	402.04	2.9094	55.32	62.64	-7.32
601919.SH	中远海控	14.95	0.5257	4.35	13.41	-9.06

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	98.44	37.75	60.68
600887.SH	伊利股份	37.1	2.863	37.50	10.89	26.62
601888.SH	中国中免	164.4	2.582	43.46	21.17	22.29
601012.SH	隆基绿能	73.43	4.277	36.48	23.01	13.48
603259.SH	药明康德	92.25	3.077	22.80	13.34	9.46
600438.SH	通威股份	44.96	1.613	27.74	20.04	7.71
601899.SH	紫金矿业	9.71	2.319	8.03	1.44	6.58
600690.SH	海尔智家	24.83	1.425	5.42	0.96	4.47
601166.SH	兴业银行	19.48	4.329	6.66	2.48	4.18
600031.SH	三一重工	15.97	1.426	5.81	2.10	3.71
600036.SH	招商银行	38.9	7.184	23.23	20.73	2.49
603501.SH	韦尔股份	157.12	1.141	6.63	7.22	-0.59
601318.SH	中国平安	43.14	7.016	5.92	7.02	-1.11
600276.SH	恒瑞医药	28.61	1.918	3.31	5.21	-1.90
600900.SH	长江电力	22.89	3.755	8.58	13.03	-4.45
601919.SH	中远海控	14.95	1.328	4.35	13.41	-9.06

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。