

成分股监测报告

2022年6月22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13日至6月17日，沪深300指数上涨114.59点。对IF指数周度涨幅提供负贡献排名前三的行业分别为：电子、采掘、公用事业；对IF指数周度涨幅提供正贡献排名前三的行业分别为：医药生物、食品饮料、非银金融。上证50指数上涨73.3点。对IH指数周度涨幅提供负贡献排名前三的行业分别为：采掘、电子、公用事业；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、非银金融、化工。中证500指数上涨127.54点。对IC指数周度涨幅提供负贡献排名前三的行业分别为：采掘、交通运输、公用事业；对IC指数周度涨幅提供正贡献排名前三的行业分别为：医药生物、非银金融、汽车。

北上资金净流入174.04亿元，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11.3亿元。在每日前十大活跃股中，沪深300指数300只成分股中有33只股票有北上资金参与，周内北上资金净买入1.13亿元，其中买入586.12亿元，卖出584.99亿元；上证50指数50只成分股中有13只股票有北上资金参与，周内净买入27.43亿元，其中买入271.05亿元，卖出243.61亿元；中证500指数500只成分股无北上资金参与。

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

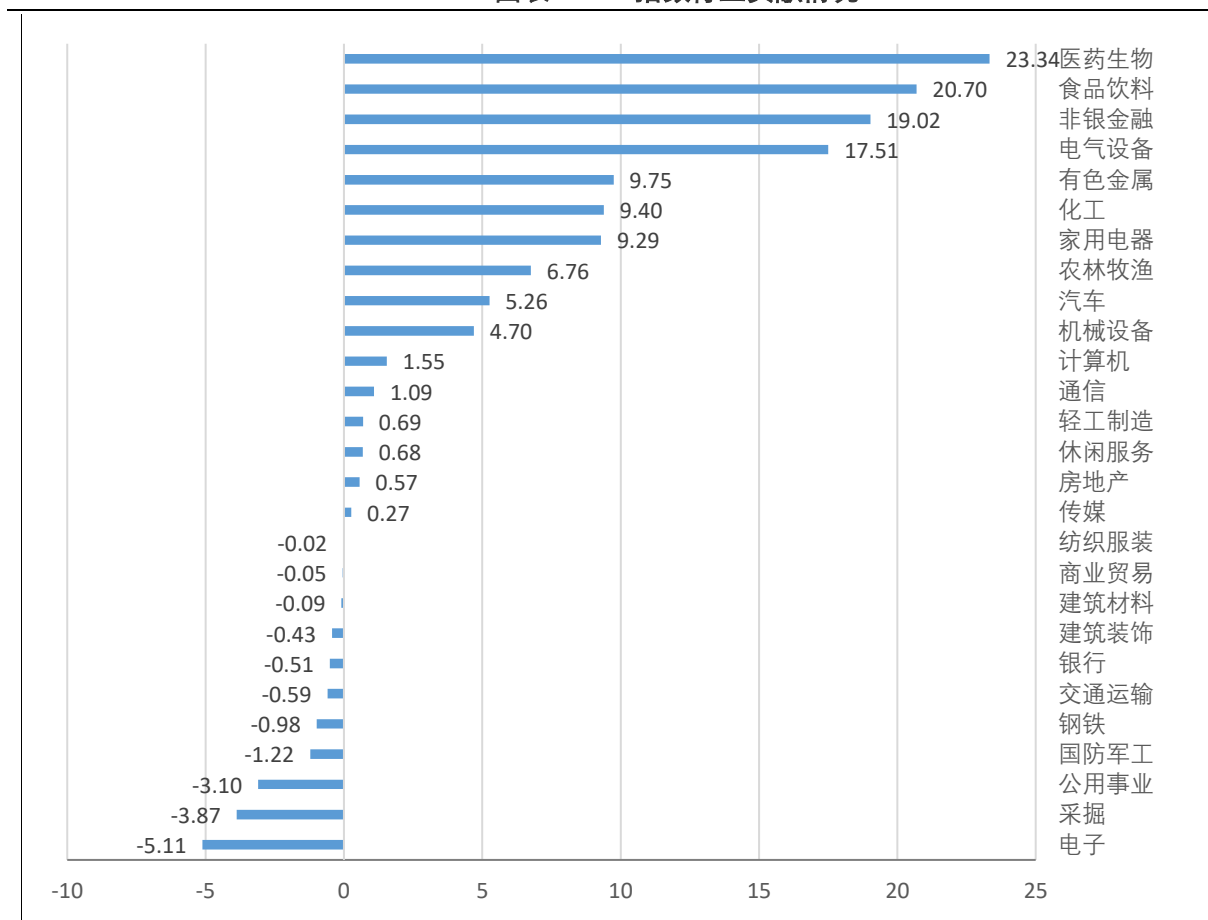
图表目录

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13日至6月17日，沪深300指数上涨114.59点。在沪深300指数的300只成分股中，有103只股票对指数上涨提供负贡献，有194只股票提供正贡献，有3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：药明康德、比亚迪、中国神华、歌尔股份、长江电力；对指数周度涨幅提供贡献点分别为：-4.42点，-2.92点，-2.5点，-1.81点，-1.67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、贵州茅台、中国平安、美的集团、长安汽车；对指数周度涨幅提供贡献点分别为：14.57点，10.34点，7.72点，4.42点，4.09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

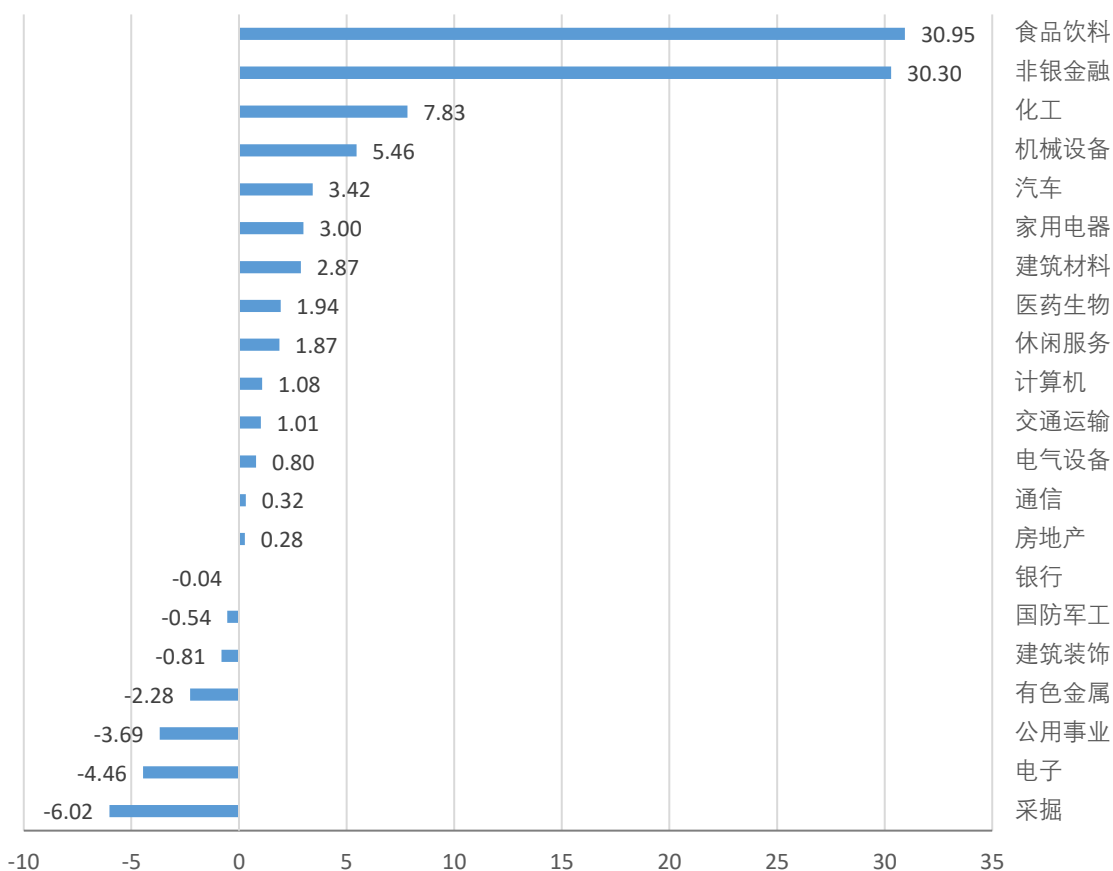
图表 2: IF 指数正/负贡献最大公司

	负贡献		正贡献	
	公司简称	点数	公司简称	点数
1	药明康德	-4.42	宁德时代	14.57
2	比亚迪	-2.92	贵州茅台	10.34
3	中国神华	-2.50	中国平安	7.72
4	歌尔股份	-1.81	美的集团	4.42
5	长江电力	-1.67	长安汽车	4.09
6	紫金矿业	-1.50	万华化学	4.02
7	立讯精密	-1.49	华友钴业	3.96
8	北方华创	-1.41	长春高新	3.87
9	澜起科技	-1.40	天赐材料	3.79
10	招商银行	-1.15	牧原股份	2.90

数据来源: wind, 兴证期货研发部

2022年6月13日至6月17日, 上证50指数上涨73.3点。在上证50指数的50只成分股中, 有16只股票对指数上涨提供负贡献, 有34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: 药明康德、中国神华、长江电力、紫金矿业、招商银行; 对指数周度涨幅提供贡献点分别为: -10.02点, -5.59点, -3.69点, -3.41点, -2.55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、中国平安、万华化学、恒瑞医药、三一重工; 对指数周度涨幅提供贡献点分别为: 23.19点, 17.19点, 9.02点, 6.01点, 5.46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

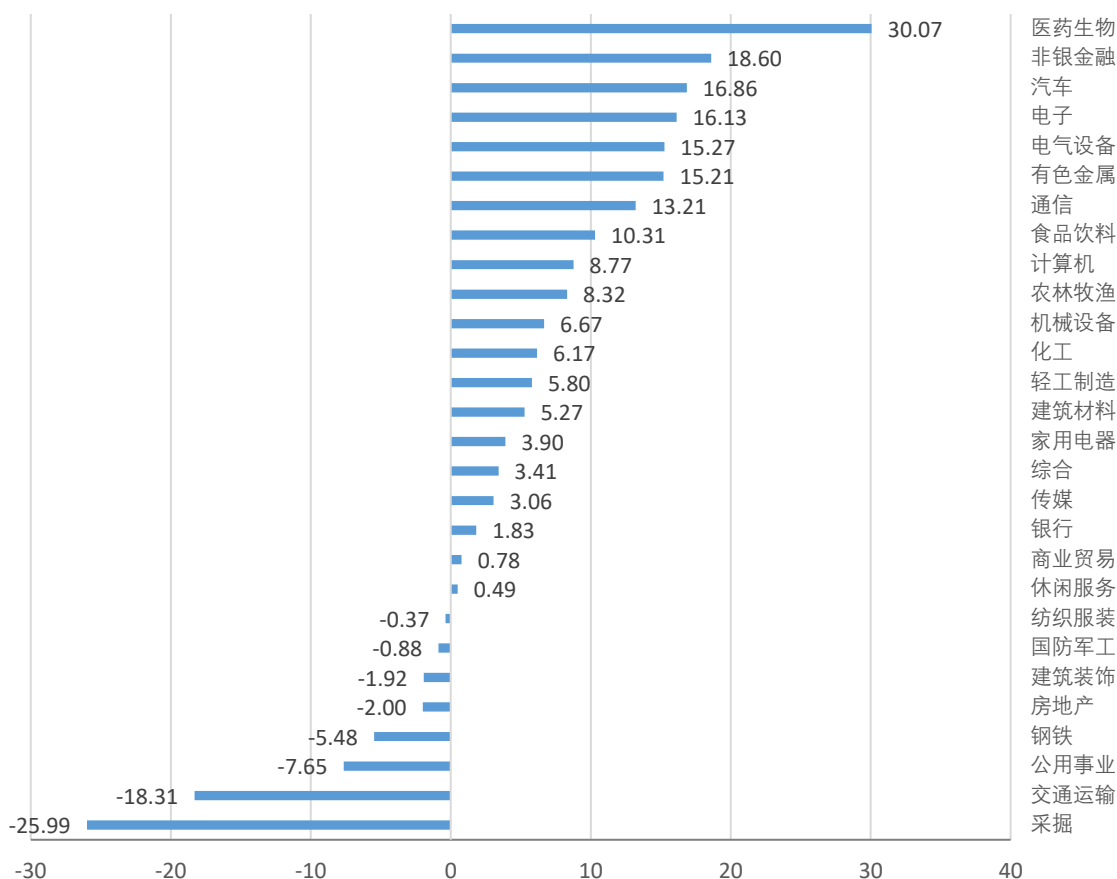
图表 4: IH 指数正/负贡献最大公司

	负贡献		正贡献	
	公司简称	点数	公司简称	点数
1	药明康德	-10.02	贵州茅台	23.19
2	中国神华	-5.59	中国平安	17.19
3	长江电力	-3.69	万华化学	9.02
4	紫金矿业	-3.41	恒瑞医药	6.01
5	招商银行	-2.55	三一重工	5.46
6	兆易创新	-2.39	片仔癀	4.76
7	韦尔股份	-2.00	伊利股份	3.86
8	中国石化	-1.20	海天味业	3.57
9	隆基绿能	-0.91	中国人寿	3.41
10	中国建筑	-0.81	中信建投	3.31

数据来源: wind, 兴证期货研发部

2022年6月13日至6月17日，中证500指数上涨127.54点。在中证500指数的500只成分股中，有188只股票对指数上涨提供负贡献，有296只股票提供正贡献，有16只股票贡献为0。分行业看，对IC指数周度涨幅提供负贡献排名前三的行业分别为：采掘、交通运输、公用事业；对IC指数周度涨幅提供正贡献排名前三的行业分别为：医药生物、非银金融、汽车。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：广汇能源、山西焦煤、兖矿能源、山煤国际、杰瑞股份；对指数周度涨幅提供贡献点分别为：-11.64点，-6.85点，-5.17点，-4.15点，-4.15点。对IC指数周度涨幅提供正贡献排名前五的股票分别为：容百科技、中天科技、迈为股份、明阳智能、拓普集团；对指数周度涨幅提供贡献点分别为：8.49点，7.94点，6.25点，5.07点，4.79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	广汇能源	-11.64	容百科技	8.49
2	山西焦煤	-6.85	中天科技	7.94
3	兖矿能源	-5.17	迈为股份	6.25
4	山煤国际	-4.15	明阳智能	5.07
5	杰瑞股份	-4.15	拓普集团	4.79
6	招商轮船	-3.78	华海药业	4.64
7	锦浪科技	-3.53	爱旭股份	4.53
8	潞安环能	-3.49	亨通光电	4.21
9	建发股份	-3.27	北汽蓝谷	4.17
10	中远海能	-2.60	振华科技	3.87

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13日至6月17日,北上资金净流入174.04亿元,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11.3亿元。在每日前十大活跃股中,沪深300指数300只成分股中有33只股票有北上资金参与,周内北上资金净买入1.13亿元,其中买入586.12亿元,卖出584.99亿元;上证50指数50只成分股中有13只股票有北上资金参与,周内净买入27.43亿元,其中买入271.05亿元,卖出243.61亿元;中证500指数500只成分股中无北上资金。

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
600887.SH	伊利股份	1.02	1.67	34.02	11.42	22.60
300059.SZ	东方财富	1.31	0.65	49.58	41.51	8.06
000625.SZ	长安汽车	0.30	4.09	27.95	20.24	7.70
000001.SZ	平安银行	0.74	0.43	7.97	1.25	6.72
600519.SH	贵州茅台	6.10	10.34	58.03	51.72	6.30
600036.SH	招商银行	2.67	-1.15	30.61	24.72	5.89
600438.SH	通威股份	0.66	0.76	27.83	22.17	5.66
000333.SZ	美的集团	1.44	4.42	17.67	13.18	4.49
300124.SZ	汇川技术	0.61	-0.04	5.62	1.92	3.70
601225.SH	陕西煤业	0.41	-0.70	4.91	1.69	3.23
000338.SZ	潍柴动力	0.31	0.80	5.21	2.28	2.93
601919.SH	中远海控	0.53	0.46	6.44	3.75	2.68
002714.SZ	牧原股份	0.72	2.90	3.65	2.08	1.57
603501.SH	韦尔股份	0.46	-0.89	4.56	3.09	1.47
000651.SZ	格力电器	0.82	1.82	5.60	4.31	1.29
601888.SH	中国中免	0.93	0.84	13.42	12.25	1.17
002812.SZ	恩捷股份	0.64	1.56	3.58	2.79	0.80
002371.SZ	北方华创	0.39	-1.41	3.59	3.52	0.06
002475.SZ	立讯精密	0.88	-1.49	7.13	7.15	-0.01
300122.SZ	智飞生物	0.38	1.73	3.75	4.34	-0.59
601012.SH	隆基绿能	1.85	-0.41	33.62	34.28	-0.66
600030.SH	中信证券	1.04	0.10	11.02	12.04	-1.01
601318.SH	中国平安	2.60	7.72	24.88	26.10	-1.22
300014.SZ	亿纬锂能	0.53	1.29	5.88	7.29	-1.41
002241.SZ	歌尔股份	0.52	-1.81	6.23	8.08	-1.85
300274.SZ	阳光电源	0.46	-0.81	5.35	7.72	-2.37
002460.SZ	赣锋锂业	0.51	2.17	13.88	18.29	-4.41
600900.SH	长江电力	1.50	-1.67	0.67	5.65	-4.98
603259.SH	药明康德	1.04	-4.42	12.06	17.16	-5.10
601166.SH	兴业银行	1.55	0.36	13.89	19.28	-5.38
000858.SZ	五粮液	1.80	2.43	23.89	31.26	-7.37
002594.SZ	比亚迪	1.48	-2.92	43.24	55.92	-12.68
300750.SZ	宁德时代	3.23	14.57	70.39	106.54	-36.15

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
600887.SH	伊利股份	2.82	3.86	34.02	11.42	22.60
600519.SH	贵州茅台	16.42	23.19	58.03	51.72	6.30
600036.SH	招商银行	7.12	-2.55	30.61	24.72	5.89
600438.SH	通威股份	1.77	1.71	27.83	22.17	5.66
601919.SH	中远海控	1.41	1.01	6.44	3.75	2.68
603501.SH	韦尔股份	1.24	-2.00	4.56	3.09	1.47
601888.SH	中国中免	2.50	1.87	13.42	12.25	1.17
601012.SH	隆基绿能	4.97	-0.91	33.62	34.28	-0.66
600030.SH	中信证券	2.81	0.22	11.02	12.04	-1.01
601318.SH	中国平安	6.94	17.19	24.88	26.10	-1.22
600900.SH	长江电力	3.96	-3.69	0.67	5.65	-4.98
603259.SH	药明康德	2.83	-10.02	12.06	17.16	-5.10
601166.SH	兴业银行	4.14	0.81	13.89	19.28	-5.38

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。