

成分股监测报告

2022年6月29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20日至6月24日，沪深300指数上涨71.94点。对IF指数周度涨幅提供负贡献排名前三的行业分别为：有色金属、采掘、银行；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、食品饮料、医药生物。上证50指数上涨39.53点。对IH指数周度涨幅提供负贡献排名前三的行业分别为：有色金属、采掘、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、非银金融、电气设备。中证500指数上涨44.88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、有色金属、化工；对IC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、国防军工。

北上资金净流入40.64亿元，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46.6亿元。在每日前十大活跃股中，沪深300指数300只成分股中有29只股票有北上资金参与，周内北上资金净买入51.18亿元，其中买入561.66亿元，卖出510.47亿元；上证50指数50只成分股中有12只股票有北上资金参与，周内净买入44.57亿元，其中买入255.8亿元，卖出211.23亿元；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

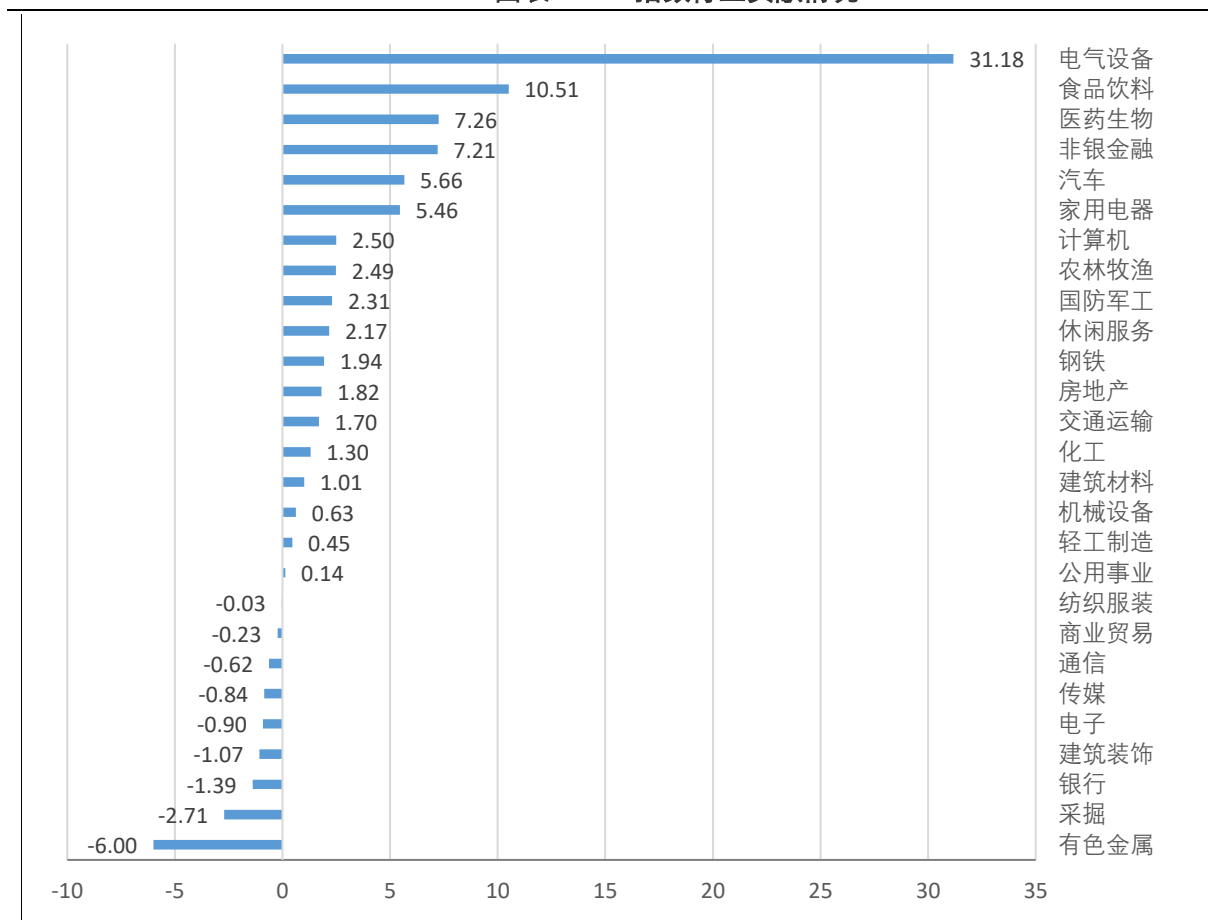
图表目录

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20日至6月24日，沪深300指数上涨71.94点。在沪深300指数的300只成分股中，有127只股票对指数上涨提供负贡献，有168只股票提供正贡献，有5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：有色金属、采掘、银行；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、食品饮料、医药生物。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：北方稀土、紫金矿业、歌尔股份、紫光国微、中国神华；对指数周度涨幅提供贡献点分别为：-1.91点，-1.79点，-1.68点，-0.9点，-0.85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、隆基绿能、美的集团、药明康德；对指数周度涨幅提供贡献点分别为：17.34点，6.11点，3.59点，2.7点，2.44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

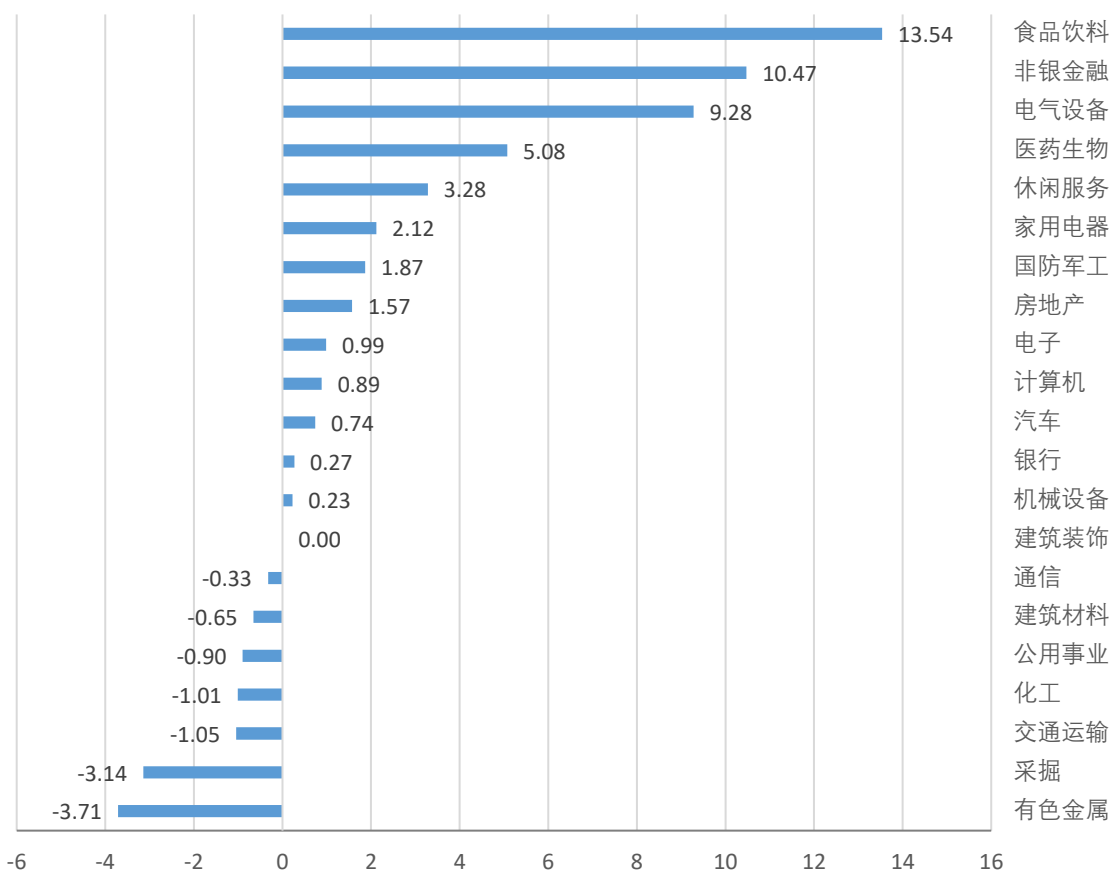
图表 2: IF 指数正/负贡献最大公司

	负贡献		正贡献	
	公司简称	点数	公司简称	点数
1	北方稀土	-1.91	宁德时代	17.34
2	紫金矿业	-1.79	贵州茅台	6.11
3	歌尔股份	-1.68	隆基绿能	3.59
4	紫光国微	-0.90	美的集团	2.70
5	中国神华	-0.85	药明康德	2.44
6	中国石油	-0.83	中国平安	2.35
7	立讯精密	-0.77	包钢股份	2.00
8	陕西煤业	-0.60	恩捷股份	1.98
9	中远海控	-0.57	比亚迪	1.92
10	兴业银行	-0.54	长安汽车	1.84

数据来源: wind, 兴证期货研发部

2022年6月20日至6月24日, 上证50指数上涨39.53点。在上证50指数的50只成分股中, 有19只股票对指数上涨提供负贡献, 有29只股票提供正贡献, 有2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: 有色金属、采掘、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、非银金融、电气设备。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: 紫金矿业、中国神华、中国石油、中远海控、兴业银行; 对指数周度涨幅提供贡献点分别为: -3.37点, -1.58点, -1.56点, -1.05点, -1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、隆基绿能、药明康德、中国平安、中国中免; 对指数周度涨幅提供贡献点分别为: 11.38点, 6.67点, 4.59点, 4.33点, 3.28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

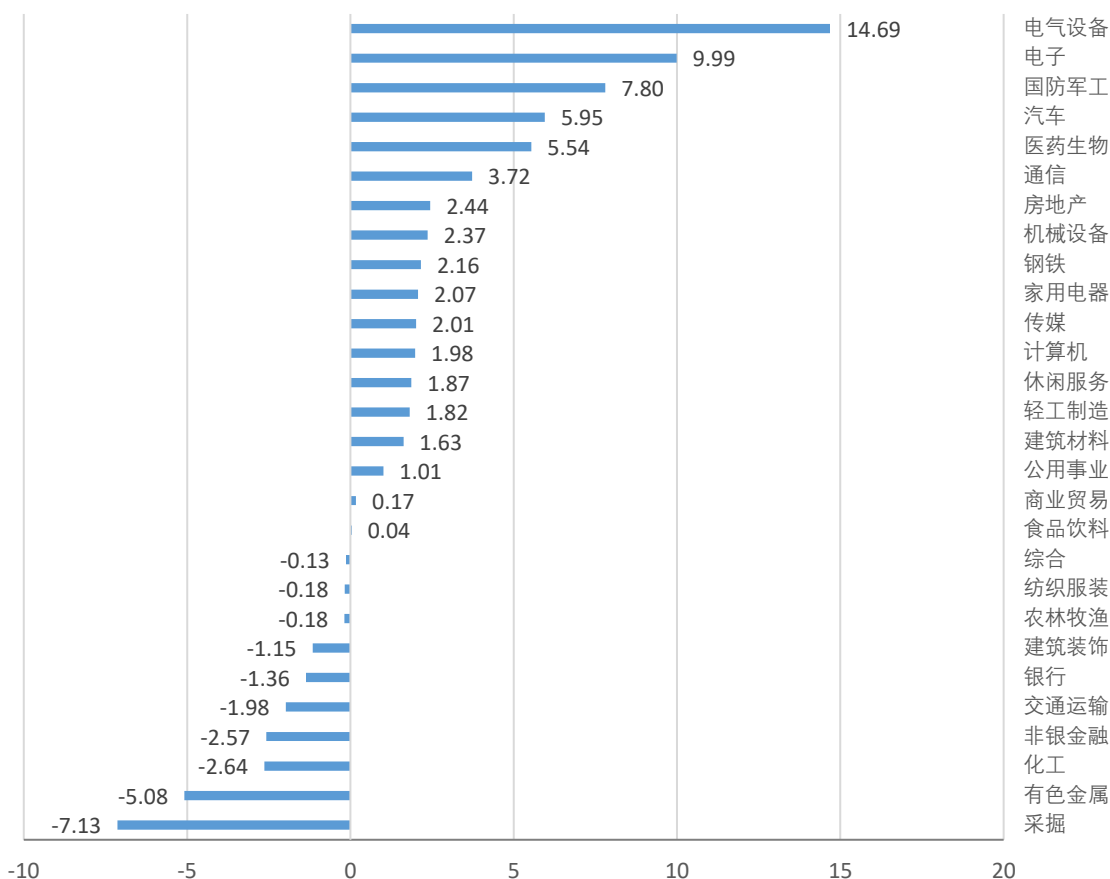
图表 4: IH 指数正/负贡献最大公司

	负贡献		正贡献	
	公司简称	点数	公司简称	点数
1	紫金矿业	-3.37	贵州茅台	11.38
2	中国神华	-1.58	隆基绿能	6.67
3	中国石油	-1.56	药明康德	4.59
4	中远海控	-1.05	中国平安	4.33
5	兴业银行	-1.00	中国中免	3.28
6	长江电力	-0.90	通威股份	2.62
7	万华化学	-0.82	中信证券	2.55
8	海螺水泥	-0.65	山西汾酒	2.33
9	伊利股份	-0.50	海尔智家	2.12
10	山东黄金	-0.34	航发动力	1.87

数据来源: wind, 兴证期货研发部

2022年6月20日至6月24日，中证500指数上涨44.88点。在中证500指数的500只成分股中，有223只股票对指数上涨提供负贡献，有265只股票提供正贡献，有12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、有色金属、化工；对IC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、国防军工。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：山西焦煤、广汇能源、兖矿能源、晶晨股份、云铝股份；对指数周度涨幅提供贡献点分别为：-2.25点，-1.98点，-1.93点，-1.84点，-1.17点。对IC指数周度涨幅提供正贡献排名前五的股票分别为：锦浪科技、东山精密、抚顺特钢、中天科技、明阳智能；对指数周度涨幅提供贡献点分别为：5.4点，3.32点，3.11点，2.8点，2.63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	山西焦煤	-2.25	锦浪科技	5.40
2	广汇能源	-1.98	东山精密	3.32
3	兖矿能源	-1.93	抚顺特钢	3.11
4	晶晨股份	-1.84	中天科技	2.80
5	云铝股份	-1.17	明阳智能	2.63
6	建发股份	-1.17	中航重机	2.47
7	西部矿业	-1.16	格林美	2.08
8	中国化学	-1.15	迈为股份	2.07
9	银泰黄金	-1.14	协鑫集成	1.98
10	昭衍新药	-1.07	宏发股份	1.68

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20日至6月24日,北上资金净流入40.64亿元,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46.6亿元。在每日前十大活跃股中,沪深300指数300只成分股中有29只股票有北上资金参与,周内北上资金净买入51.18亿元,其中买入561.66亿元,卖出510.47亿元;上证50指数50只成分股中有12只股票有北上资金参与,周内净买入44.57亿元,其中买入255.8亿元,卖出211.23亿元;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	6.10	6.11	74.17	42.88	31.29
300059.SZ	东方财富	1.31	1.30	36.38	17.46	18.92
000651.SZ	格力电器	0.82	1.05	26.87	12.01	14.87
603259.SH	药明康德	1.04	2.44	15.93	4.69	11.24
600438.SH	通威股份	0.66	1.41	31.97	20.88	11.08
002812.SZ	恩捷股份	0.64	1.98	18.41	8.58	9.83
601318.SH	中国平安	2.60	2.35	15.46	6.30	9.16
601012.SH	隆基绿能	1.85	3.59	35.11	26.50	8.61
300124.SZ	汇川技术	0.61	1.54	7.44	2.07	5.37
002466.SZ	天齐锂业	0.54	-0.18	9.93	5.48	4.45
300274.SZ	阳光电源	0.46	0.84	27.58	23.88	3.70
300450.SZ	先导智能	0.29	1.00	4.76	1.88	2.88
600111.SH	北方稀土	0.41	-1.91	12.55	9.93	2.62
600745.SH	闻泰科技	0.26	0.48	4.56	2.06	2.51
601225.SH	陕西煤业	0.41	-0.60	3.97	2.00	1.98
600031.SH	三一重工	0.54	0.12	4.18	3.14	1.05
002594.SZ	比亚迪	1.48	1.92	34.41	33.97	0.44
600887.SH	伊利股份	1.02	-0.26	6.13	6.90	-0.77
000333.SZ	美的集团	1.44	2.70	8.03	9.22	-1.20
002460.SZ	赣锋锂业	0.51	-0.45	2.82	4.16	-1.34
002475.SZ	立讯精密	0.88	-0.77	16.18	18.13	-1.95
603501.SH	韦尔股份	0.46	-0.08	15.62	18.56	-2.93
600036.SH	招商银行	2.67	0.79	25.43	31.30	-5.88
601888.SH	中国中免	0.93	1.77	20.01	25.99	-5.98
000625.SZ	长安汽车	0.30	1.84	14.20	21.72	-7.52
002241.SZ	歌尔股份	0.52	-1.68	21.46	29.83	-8.38
601899.SH	紫金矿业	0.77	-1.79	7.23	22.03	-14.80
000858.SZ	五粮液	1.80	1.28	18.46	35.66	-17.20
300750.SZ	宁德时代	3.23	17.34	42.42	63.28	-20.86

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	16.42	11.38	74.17	42.88	31.29
603259.SH	药明康德	2.83	4.59	15.93	4.69	11.24
600438.SH	通威股份	1.77	2.62	31.97	20.88	11.08
601318.SH	中国平安	6.94	4.33	15.46	6.30	9.16
601012.SH	隆基绿能	4.97	6.67	35.11	26.50	8.61
600745.SH	闻泰科技	0.69	0.89	4.56	2.06	2.51
600031.SH	三一重工	1.46	0.23	4.18	3.14	1.05
600887.SH	伊利股份	2.82	-0.50	6.13	6.90	-0.77
603501.SH	韦尔股份	1.24	-0.15	15.62	18.56	-2.93
600036.SH	招商银行	7.12	1.46	25.43	31.30	-5.88
601888.SH	中国中免	2.50	3.28	20.01	25.99	-5.98
601899.SH	紫金矿业	2.10	-3.37	7.23	22.03	-14.80

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。