

成分股监测报告

2022年7月13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7月4日至7月8日，沪深300指数下跌18.43点。对IF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、非银金融、银行；对IF指数周度跌幅提供正贡献排名前三的行业分别为：电气设备、农林牧渔、医药生物。上证50指数下跌37.75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、银行、非银金融；对IH指数周度跌幅提供正贡献排名前三的行业分别为：医药生物、国防军工、交通运输。中证500指数下跌40.64点。对IC指数周度跌幅提供负贡献排名前三的行业分别为：化工、交通运输、电子；对IC指数周度跌幅提供正贡献排名前三的行业分别为：公用事业、医药生物、电气设备。

北上资金净流入35.6亿元，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18.75亿元。在每日前十大活跃股中，沪深300指数300只成分股中有28只股票有北上资金参与，周内北上资金净买入48.48亿元，其中买入563.08亿元，卖出514.6亿元；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12.7亿元，其中买入247.68亿元，卖出234.98亿元；中证500指数500只成分股中有1只股票有北上资金参与，周内净卖出10.77亿元，其中买入6.07亿元，卖出16.84亿元。

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

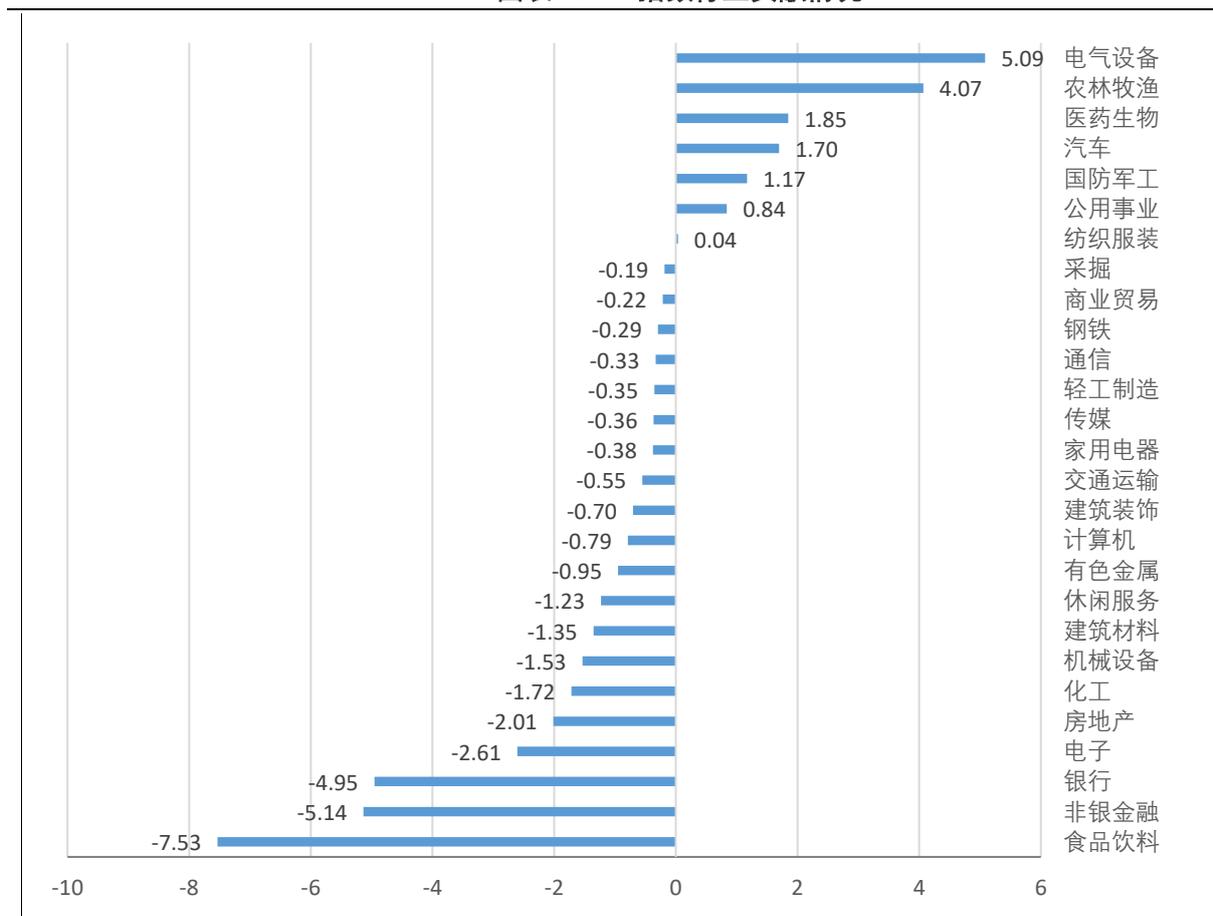
图表目录

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7月4日至7月8日，沪深300指数下跌18.43点。在沪深300指数的300只成分股中，有215只股票对指数下跌提供负贡献，有82只股票提供正贡献，有3只股票贡献为0。分行业看，对IF指数周度跌幅提供负贡献排名前三的行业分别为：食品饮料、非银金融、银行；对IF指数周度跌幅提供正贡献排名前三的行业分别为：电气设备、农林牧渔、医药生物。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：招商银行、五粮液、贵州茅台、东方财富、隆基绿能；对指数周度跌幅提供贡献点分别为：-2.05点，-1.85点，-1.83点，-1.66点，-1.57点。对IF指数周度跌幅提供正贡献排名前五的股票分别为：宁德时代、牧原股份、药明康德、温氏股份、天齐锂业；对指数周度跌幅提供贡献点分别为：2.3点，1.78点，1.52点，1.32点，1.23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

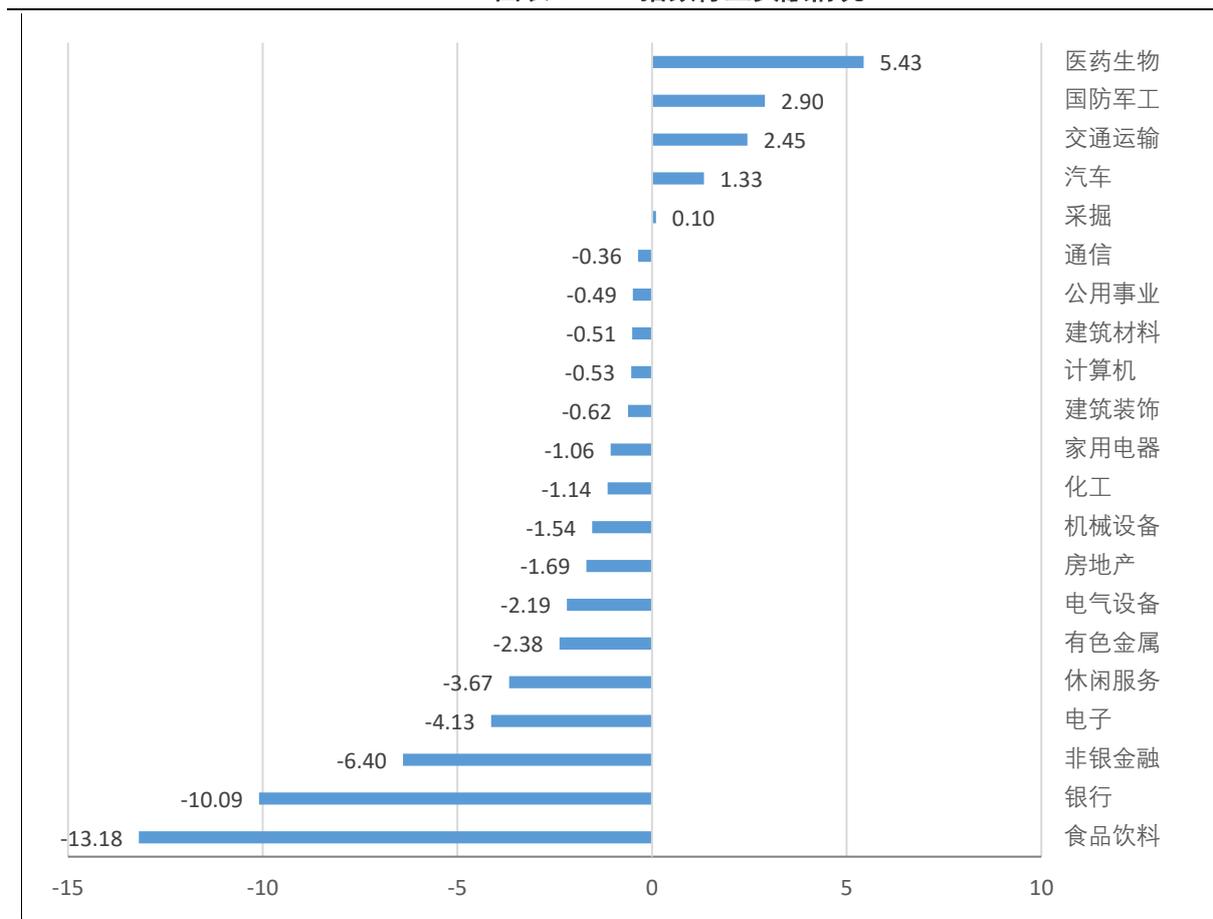
图表 2: IF 指数正/负贡献最大公司

	负贡献		正贡献	
	公司简称	点数	公司简称	点数
1	招商银行	-2.05	宁德时代	2.30
2	五粮液	-1.85	牧原股份	1.78
3	贵州茅台	-1.83	药明康德	1.52
4	东方财富	-1.66	温氏股份	1.32
5	隆基绿能	-1.57	天齐锂业	1.23
6	伊利股份	-1.13	通威股份	0.91
7	中国中免	-1.10	航发动力	0.89
8	兴业银行	-0.93	亿纬锂能	0.84
9	东方雨虹	-0.84	阳光电源	0.83
10	海康威视	-0.81	比亚迪	0.80

数据来源: wind, 兴证期货研发部

2022年7月4日至7月8日, 上证50指数下跌37.75点。在上证50指数的50只成分股中, 有37只股票对指数下跌提供负贡献, 有11只股票提供正贡献, 有2只股票贡献为0。分行业看, 对IH指数周度跌幅提供负贡献排名前三的行业分别为: 食品饮料、银行、非银金融; 对IH指数周度跌幅提供正贡献排名前三的行业分别为: 医药生物、国防军工、交通运输。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: 招商银行、贵州茅台、隆基绿能、伊利股份、中国中免; 对指数周度跌幅提供贡献点分别为: -6.79点, -6.12点, -5.22点, -3.87点, -3.67点。对IH指数周度跌幅提供正贡献排名前五的股票分别为: 药明康德、通威股份、航发动力、中远海控、复星医药; 对指数周度跌幅提供贡献点分别为: 5.13点, 3.04点, 2.9点, 2.45点, 1.93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

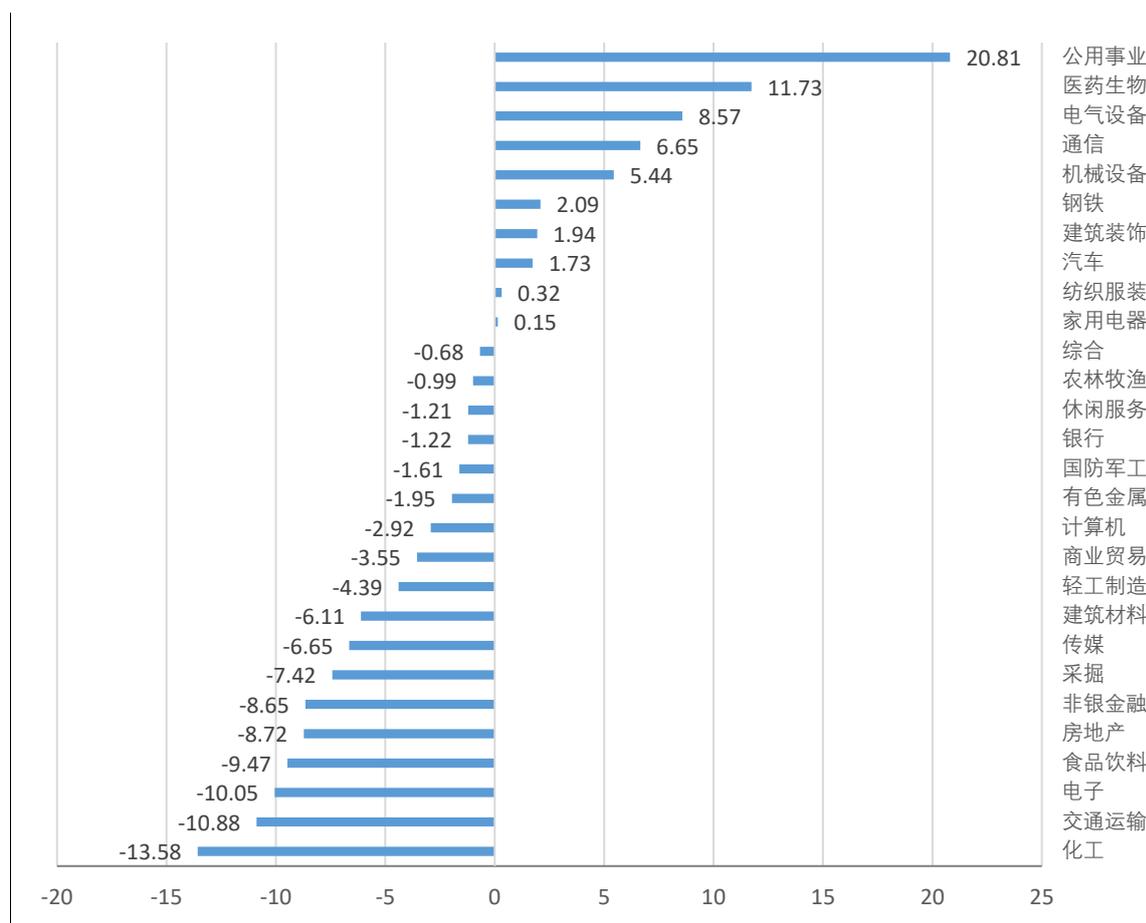
图表 4: IH 指数正/负贡献最大公司

	负贡献		正贡献	
	公司简称	点数	公司简称	点数
1	招商银行	-6.79	药明康德	5.13
2	贵州茅台	-6.12	通威股份	3.04
3	隆基绿能	-5.22	航发动力	2.90
4	伊利股份	-3.87	中远海控	2.45
5	中国中免	-3.67	复星医药	1.93
6	兴业银行	-3.09	上汽集团	1.84
7	紫金矿业	-2.23	中国神华	0.41
8	中信证券	-2.22	恒生电子	0.28
9	韦尔股份	-2.18	农业银行	0.26
10	中国平安	-1.85	国泰君安	0.11

数据来源: wind, 兴证期货研发部

2022年7月4日至7月8日，中证500指数下跌40.64点。在中证500指数的500只成分股中，有335只股票对指数下跌提供负贡献，有153只股票提供正贡献，有12只股票贡献为0。分行业看，对IC指数周度跌幅提供负贡献排名前三的行业分别为：化工、交通运输、电子；对IC指数周度跌幅提供正贡献排名前三的行业分别为：公用事业、医药生物、电气设备。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：山煤国际、广汇能源、兴发集团、明阳智能、中国宝安；对指数周度跌幅提供贡献点分别为：-4.08点，-3.9点，-3.26点，-2.57点，-2.46点。对IC指数周度跌幅提供正贡献排名前五的股票分别为：攀钢钒钛、捷佳伟创、思源电气、亨通光电、永泰能源；对指数周度跌幅提供贡献点分别为：6.44点，5.78点，4.69点，4.4点，4.13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	山煤国际	-4.08	攀钢钒钛	6.44
2	广汇能源	-3.90	捷佳伟创	5.78
3	兴发集团	-3.26	思源电气	4.69
4	明阳智能	-2.57	亨通光电	4.40
5	中国宝安	-2.46	永泰能源	4.13
6	上海家化	-2.38	华电国际	3.73
7	旗滨集团	-2.28	中天科技	3.62
8	国瓷材料	-2.25	昭衍新药	3.46
9	建发股份	-2.23	九洲药业	3.33
10	招商南油	-2.22	容百科技	3.30

数据来源: wind, 兴证期货研发部

2. 北上资金个股流向

2022年7月4日至7月8日,北上资金净流入35.6亿元,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18.75亿元。在每日前十大活跃股中,沪深300指数300只成分股中有28只股票有北上资金参与,周内北上资金净买入48.48亿元,其中买入563.08亿元,卖出514.6亿元;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12.7亿元,其中买入247.68亿元,卖出234.98亿元;中证500指数500只成分股中有1只股票有北上资金参与,周内净卖出10.77亿元,其中买入6.07亿元,卖出16.84亿元。

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
002466.SZ	天齐锂业	0.54	1.23	36.74	15.23	21.51
300750.SZ	宁德时代	3.23	2.30	65.30	50.70	14.60
600519.SH	贵州茅台	6.10	-1.83	46.49	32.06	14.43
601888.SH	中国中免	0.93	-1.10	36.55	22.97	13.58
300059.SZ	东方财富	1.31	-1.66	15.67	7.14	8.53
000333.SZ	美的集团	1.44	-0.10	13.42	5.01	8.41
000858.SZ	五粮液	1.80	-1.85	28.41	20.50	7.91
002714.SZ	牧原股份	0.72	1.78	18.79	13.13	5.65
601919.SH	中远海控	0.53	0.74	5.90	1.03	4.87
603799.SH	华友钴业	0.52	-0.64	5.33	1.60	3.73
002475.SZ	立讯精密	0.88	0.28	18.17	14.70	3.46
002371.SZ	北方华创	0.39	0.64	13.73	10.61	3.12
600900.SH	长江电力	1.50	-0.15	6.04	3.13	2.92
601318.SH	中国平安	2.60	-0.56	5.05	2.57	2.47
300014.SZ	亿纬锂能	0.53	0.84	20.37	18.22	2.15
300124.SZ	汇川技术	0.61	-0.08	7.10	5.30	1.80
600036.SH	招商银行	2.67	-2.05	14.93	13.51	1.43
601012.SH	隆基绿能	1.85	-1.57	35.73	34.82	0.91
600438.SH	通威股份	0.66	0.91	29.65	28.86	0.79
002594.SZ	比亚迪	1.48	0.80	31.30	31.47	-0.17
300274.SZ	阳光电源	0.46	0.83	25.07	27.24	-2.18
601899.SH	紫金矿业	0.77	-0.66	1.96	4.63	-2.66
600887.SH	伊利股份	1.02	-1.13	21.70	24.58	-2.89
000625.SZ	长安汽车	0.30	-0.10	7.37	13.21	-5.84
600276.SH	恒瑞医药	0.73	-0.13	7.48	13.96	-6.48
603501.SH	韦尔股份	0.46	-0.65	13.06	21.06	-8.00
603259.SH	药明康德	1.04	1.52	23.12	31.80	-8.68
002460.SZ	赣锋锂业	0.51	-0.32	8.65	20.63	-11.98
300450.SZ	先导智能	0.29	-0.34	0.00	24.93	-24.93

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	-6.12	46.49	32.06	14.43
601888.SH	中国中免	2.50	-3.67	36.55	22.97	13.58
601919.SH	中远海控	1.41	2.45	5.90	1.03	4.87
600900.SH	长江电力	3.96	-0.49	6.04	3.13	2.92
601318.SH	中国平安	6.94	-1.85	5.05	2.57	2.47
600036.SH	招商银行	7.12	-6.79	14.93	13.51	1.43
601012.SH	隆基绿能	4.97	-5.22	35.73	34.82	0.91
600438.SH	通威股份	1.77	3.04	29.65	28.86	0.79
601899.SH	紫金矿业	2.10	-2.23	1.96	4.63	-2.66
600887.SH	伊利股份	2.82	-3.87	21.70	24.58	-2.89
600276.SH	恒瑞医药	1.97	-0.43	7.48	13.96	-6.48
603501.SH	韦尔股份	1.24	-2.18	13.06	21.06	-8.00
603259.SH	药明康德	2.83	5.13	23.12	31.80	-8.68

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
601615.SH	明阳智能	0.65	-2.57	6.07	16.84	-10.77

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。