

成分股监测报告

2022年7月20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11日至7月15日，沪深300指数下跌157.62点。对IF指数周度跌幅提供负贡献排名前三的行业分别为：银行、非银金融、电子；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、纺织服装、国防军工。上证50指数下跌134.97点。对IH指数周度跌幅提供负贡献排名前三的行业分别为：银行、非银金融、食品饮料；对IH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、通信、国防军工。中证500指数下跌190.65点。对IC指数周度跌幅提供负贡献排名前三的行业分别为：电子、医药生物、有色金属；对IC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、汽车、通信。

北上资金净流出220.408亿元，统计每日北上资金前十大活跃股个股成交情况，周内合计净流出62.81亿元。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，周内北上资金净卖出70.73亿元，其中买入504.11亿元，卖出574.84亿元；上证50指数50只成分股中有13只股票有北上资金参与，周内净卖出42.73亿元，其中买入216.63亿元，卖出259.36亿元；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1.02亿元，其中买入3.23亿元，卖出4.25亿元。

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

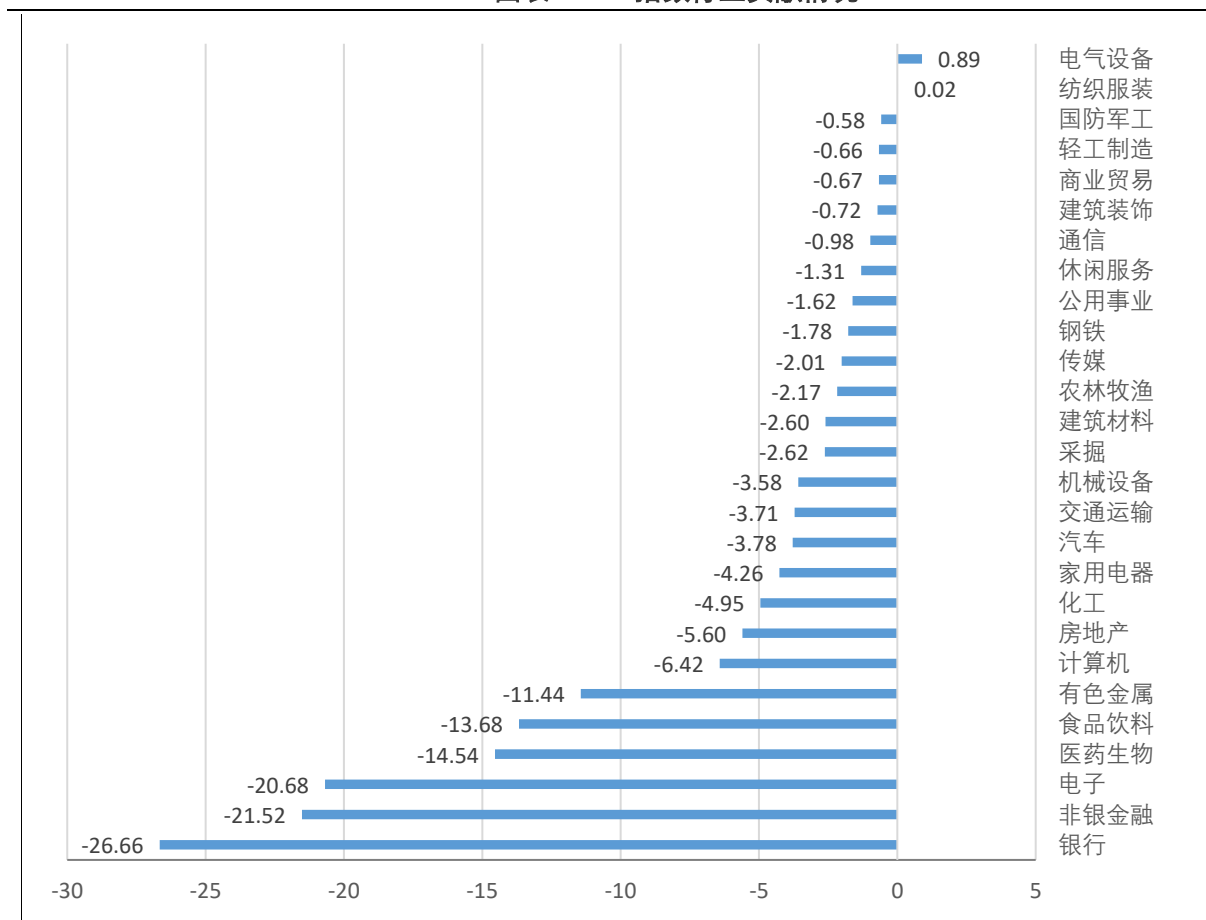
图表目录

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11日至7月15日，沪深300指数下跌157.62点。在沪深300指数的300只成分股中，有262只股票对指数下跌提供负贡献，有37只股票提供正贡献，有1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：银行、非银金融、电子；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、纺织服装、国防军工。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、中国平安、贵州茅台、兴业银行、天齐锂业；对指数周度跌幅提供贡献点分别为：-9.78点，-7.52点，-6.44点，-5.73点，-3.71点。对IF指数周度跌幅提供正贡献排名前五的股票分别为：阳光电源、国电南瑞、天合光能、福斯特、正泰电器；对指数周度跌幅提供贡献点分别为：3.84点，1.24点，1.04点，1.02点，0.81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

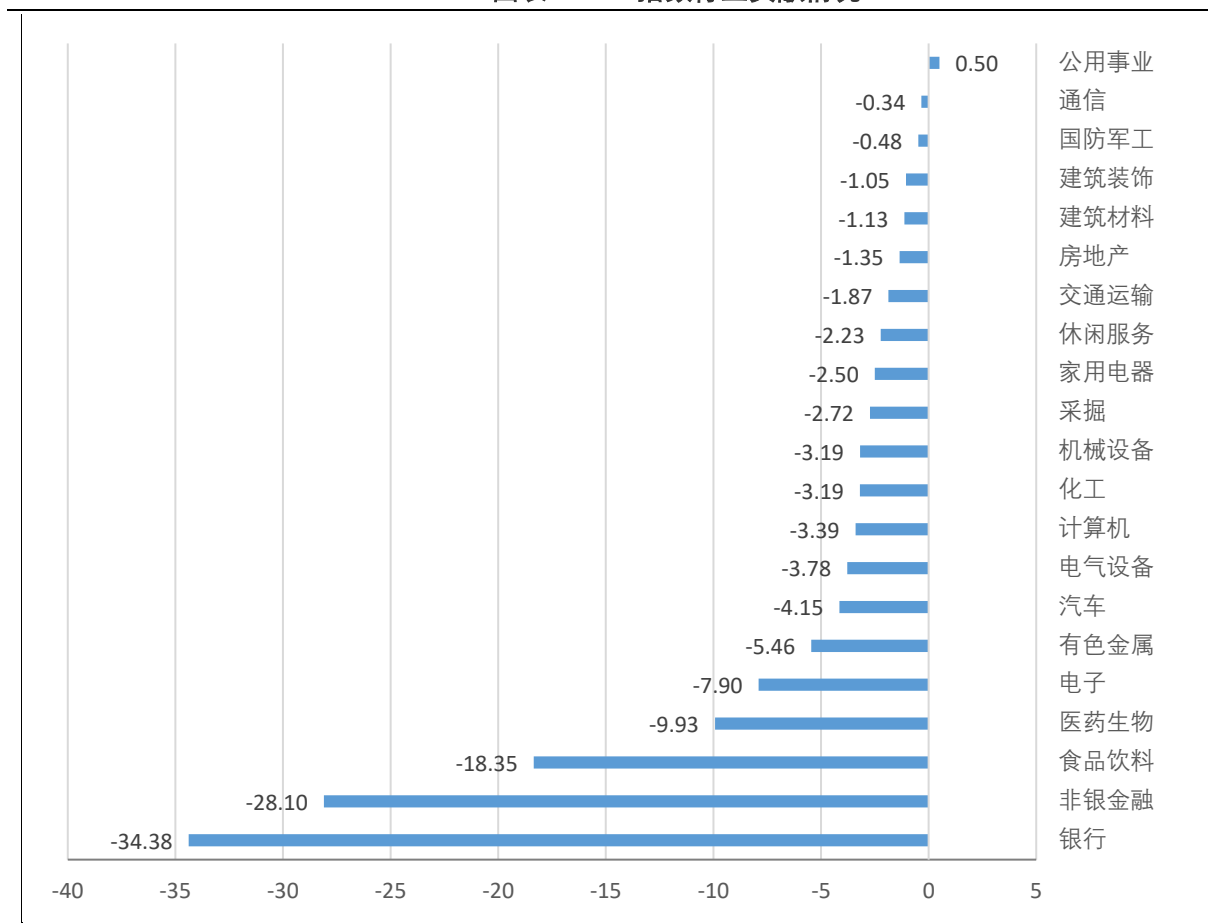
图表 2: IF 指数正/负贡献最大公司

	负贡献		正贡献	
	公司简称	点数	公司简称	点数
1	招商银行	-9.78	阳光电源	3.84
2	中国平安	-7.52	国电南瑞	1.24
3	贵州茅台	-6.44	天合光能	1.04
4	兴业银行	-5.73	福斯特	1.02
5	天齐锂业	-3.71	正泰电器	0.81
6	美的集团	-3.54	先导智能	0.54
7	东方财富	-2.90	中国中铁	0.47
8	平安银行	-2.83	东方盛虹	0.41
9	海康威视	-2.57	金风科技	0.39
10	紫金矿业	-2.54	爱尔眼科	0.37

数据来源: wind, 兴证期货研发部

2022年7月11日至7月15日, 上证50指数下跌134.97点。在上证50指数的50只成分股中, 有48只股票对指数下跌提供负贡献, 有1只股票提供正贡献, 有1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: 银行、非银金融、食品饮料; 对IH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、通信、国防军工。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、中国平安、贵州茅台、兴业银行、紫金矿业; 对指数周度跌幅提供贡献点分别为: -18.83点, -14.48点, -12.5点, -11.08点, -4.99点。对IH指数周度跌幅提供正贡献排名前五的股票分别为: 长江电力、中国电信、中金公司、中国联通、隆基绿能; 对指数周度跌幅提供贡献点分别为: 0.5点, 0点, -0.25点, -0.34点, -0.34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

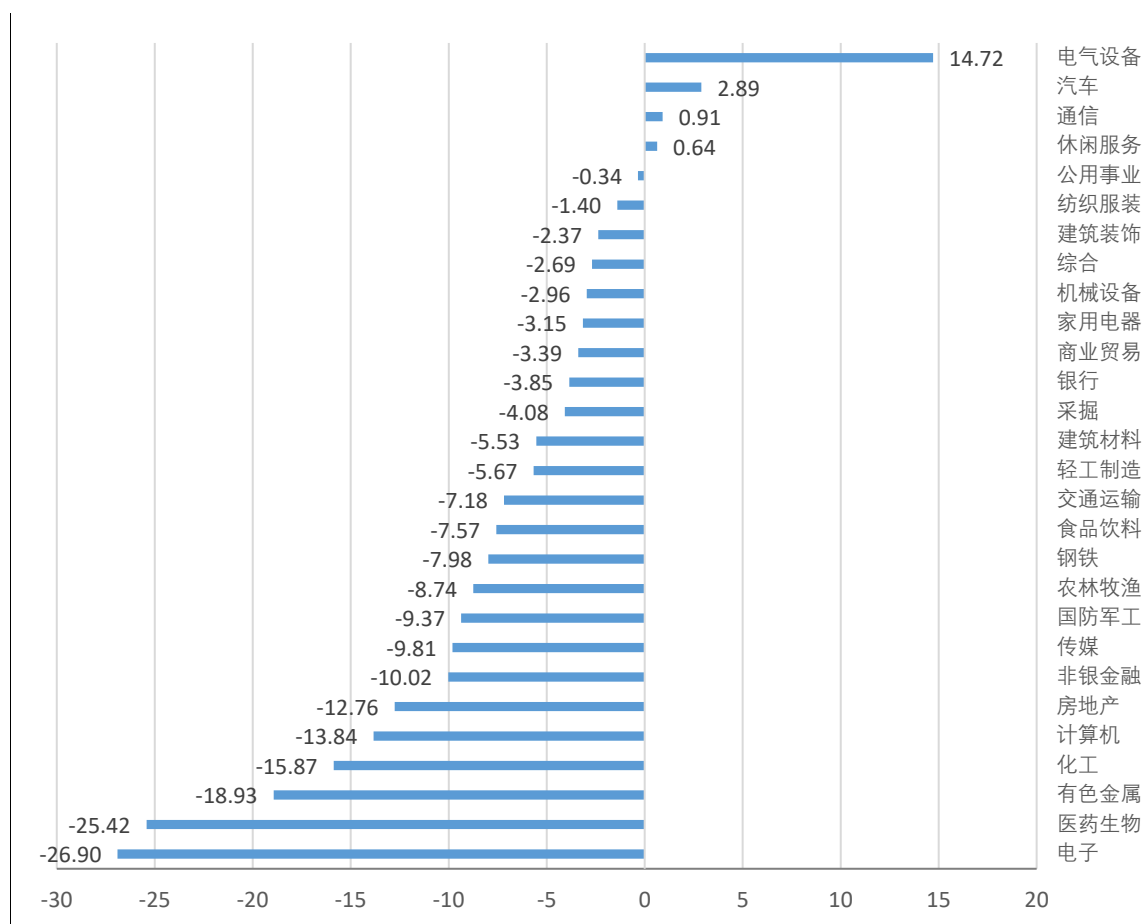
图表 4: IH 指数正/负贡献最大公司

	负贡献		正贡献	
	公司简称	点数	公司简称	点数
1	招商银行	-18.83	长江电力	0.50
2	中国平安	-14.48	中国电信	0.00
3	贵州茅台	-12.50	中金公司	-0.25
4	兴业银行	-11.08	中国联通	-0.34
5	紫金矿业	-4.99	隆基绿能	-0.34
6	中信证券	-4.60	中国石化	-0.39
7	药明康德	-4.11	山东黄金	-0.47
8	韦尔股份	-3.85	航发动力	-0.48
9	通威股份	-3.44	新华保险	-0.55
10	上汽集团	-3.41	工业富联	-0.67

数据来源: wind, 兴证期货研发部

2022年7月11日至7月15日，中证500指数下跌190.65点。在中证500指数的500只成分股中，有422只股票对指数下跌提供负贡献，有76只股票提供正贡献，有2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：电子、医药生物、有色金属；对IC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、汽车、通信。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：索菲亚、晶晨股份、广汇能源、振华科技、大北农；对指数周度跌幅提供贡献点分别为：-4.04点，-3.23点，-3.13点，-2.85点，-2.53点。对IC指数周度跌幅提供正贡献排名前五的股票分别为：拓普集团、明阳智能、华阳股份、中天科技、均胜电子；对指数周度跌幅提供贡献点分别为：4.82点，4.04点，3.9点，3.51点，2.65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	索菲亚	-4.04	拓普集团	4.82
2	晶晨股份	-3.23	明阳智能	4.04
3	广汇能源	-3.13	华阳股份	3.90
4	振华科技	-2.85	中天科技	3.51
5	大北农	-2.53	均胜电子	2.65
6	立昂微	-2.52	光威复材	2.51
7	兴发集团	-2.44	思源电气	2.36
8	杰瑞股份	-2.44	河钢股份	2.08
9	华菱钢铁	-2.42	杭氧股份	1.82
10	圆通速递	-2.38	抚顺特钢	1.71

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11日至7月15日,北上资金净流出220.408亿元,统计每日北上资金前十大活跃股个股成交情况,周内合计净流出62.81亿元。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,周内北上资金净卖出70.73亿元,其中买入504.11亿元,卖出574.84亿元;上证50指数50只成分股中有13只股票有北上资金参与,周内净卖出42.73亿元,其中买入216.63亿元,卖出259.36亿元;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1.02亿元,其中买入3.23亿元,卖出4.25亿元。

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
300760.SZ	迈瑞医疗	0.80	0.04	20.76	10.17	10.59
002594.SZ	比亚迪	1.48	0.04	67.56	59.59	7.97
601012.SH	隆基绿能	1.85	-0.18	36.58	29.36	7.22
600438.SH	通威股份	0.66	-1.78	31.43	24.64	6.80
600519.SH	贵州茅台	6.10	-6.44	41.98	35.48	6.50
000625.SZ	长安汽车	0.30	0.07	12.14	6.74	5.40
600031.SH	三一重工	0.54	-1.64	5.68	2.22	3.46
603799.SH	华友钴业	0.52	-0.16	8.54	5.39	3.14
000333.SZ	美的集团	1.44	-3.54	10.32	7.60	2.73
002709.SZ	天赐材料	0.25	-0.58	6.09	3.57	2.52
600406.SH	国电南瑞	0.53	1.24	10.55	8.39	2.16
601888.SH	中国中免	0.93	-1.15	21.59	19.68	1.92
603259.SH	药明康德	1.04	-2.09	12.92	11.24	1.69
601668.SH	中国建筑	0.63	-0.55	3.57	2.62	0.95
300059.SZ	东方财富	1.31	-2.90	4.17	3.36	0.81
002352.SZ	顺丰控股	0.56	-1.53	3.89	3.68	0.21
002460.SZ	赣锋锂业	0.51	-1.70	3.50	4.27	-0.77
002466.SZ	天齐锂业	0.54	-3.71	32.31	33.54	-1.23
300014.SZ	亿纬锂能	0.53	-0.11	10.33	12.23	-1.90
601919.SH	中远海控	0.53	-0.97	1.92	4.37	-2.45
002714.SZ	牧原股份	0.72	-0.17	4.41	7.23	-2.82
002142.SZ	宁波银行	0.70	-1.26	1.63	4.78	-3.15
002371.SZ	北方华创	0.39	-1.30	2.48	5.90	-3.42
000858.SZ	五粮液	1.80	-1.11	17.44	21.36	-3.92
600887.SH	伊利股份	1.02	-0.79	15.78	21.10	-5.32
600900.SH	长江电力	1.50	0.26	12.46	18.13	-5.67
002475.SZ	立讯精密	0.88	-1.66	8.09	14.53	-6.44
601318.SH	中国平安	2.60	-7.52	10.15	17.28	-7.13
300750.SZ	宁德时代	3.23	-2.03	45.00	54.93	-9.94
000001.SZ	平安银行	0.74	-2.83	2.15	15.22	-13.07
300274.SZ	阳光电源	0.46	3.84	16.12	33.00	-16.88
601166.SH	兴业银行	1.55	-5.73	5.35	25.50	-20.15
600036.SH	招商银行	2.67	-9.78	17.20	47.75	-30.54

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
601012.SH	隆基绿能	4.97	-0.34	36.58	29.36	7.22
600438.SH	通威股份	1.77	-3.44	31.43	24.64	6.80
600519.SH	贵州茅台	16.42	-12.50	41.98	35.48	6.50
600031.SH	三一重工	1.46	-3.19	5.68	2.22	3.46
601888.SH	中国中免	2.50	-2.23	21.59	19.68	1.92
603259.SH	药明康德	2.83	-4.11	12.92	11.24	1.69
601668.SH	中国建筑	1.68	-1.05	3.57	2.62	0.95
601919.SH	中远海控	1.41	-1.87	1.92	4.37	-2.45
600887.SH	伊利股份	2.82	-1.57	15.78	21.10	-5.32
600900.SH	长江电力	3.96	0.50	12.46	18.13	-5.67
601318.SH	中国平安	6.94	-14.48	10.15	17.28	-7.13
601166.SH	兴业银行	4.14	-11.08	5.35	25.50	-20.15
600036.SH	招商银行	7.12	-18.83	17.20	47.75	-30.54

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	4.04	3.23	4.25	-1.02

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。