

成分股监测报告

2022年7月27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18日至7月22日，沪深300指数下跌23.92点。对IF指数周度跌幅提供负贡献排名前三的行业分别为：非银金融、银行、计算机；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、医药生物、化工。上证50指数下跌1.55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指数上涨73.43点。对IC指数周度涨幅提供负贡献排名前三的行业分别为：医药生物、电气设备、食品饮料；对IC指数周度涨幅提供正贡献排名前三的行业分别为：交通运输、有色金属、计算机。

北上资金净流出37.36亿元，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13.79亿元。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20.26亿元，其中买入360.28亿元，卖出340.02亿元；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17.61亿元，其中买入150.07亿元，卖出132.46亿元；中证500指数500只成分股中有2只股票有北上资金参与，周内净卖出1.33亿元，其中买入16.59亿元，卖出17.93亿元。

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

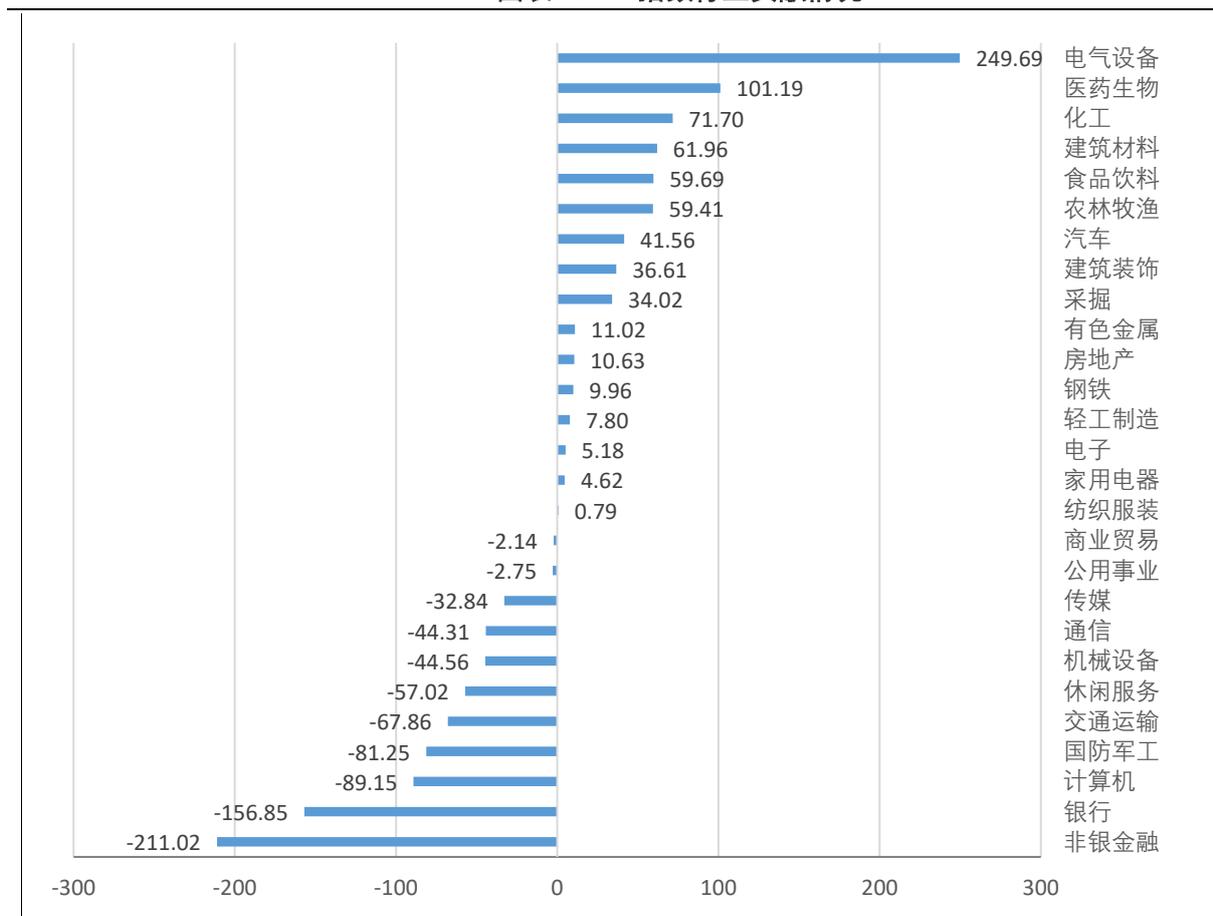
图表目录

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18日至7月22日，沪深300指数下跌23.92点。在沪深300指数的300只成分股中，有174只股票对指数下跌提供负贡献，有124只股票提供正贡献，有2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：非银金融、银行、计算机；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、医药生物、化工。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、中国中免、东方财富、长江电力、中国船舶；对指数周度跌幅提供贡献点分别为：-63.54点，-54.01点，-47.05点，-46.19点，-41.66点。对IF指数周度跌幅提供正贡献排名前五的股票分别为：隆基绿能、恩捷股份、立讯精密、牧原股份、阳光电源；对指数周度跌幅提供贡献点分别为：65.38点，63.27点，56.2点，48.93点，45.91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

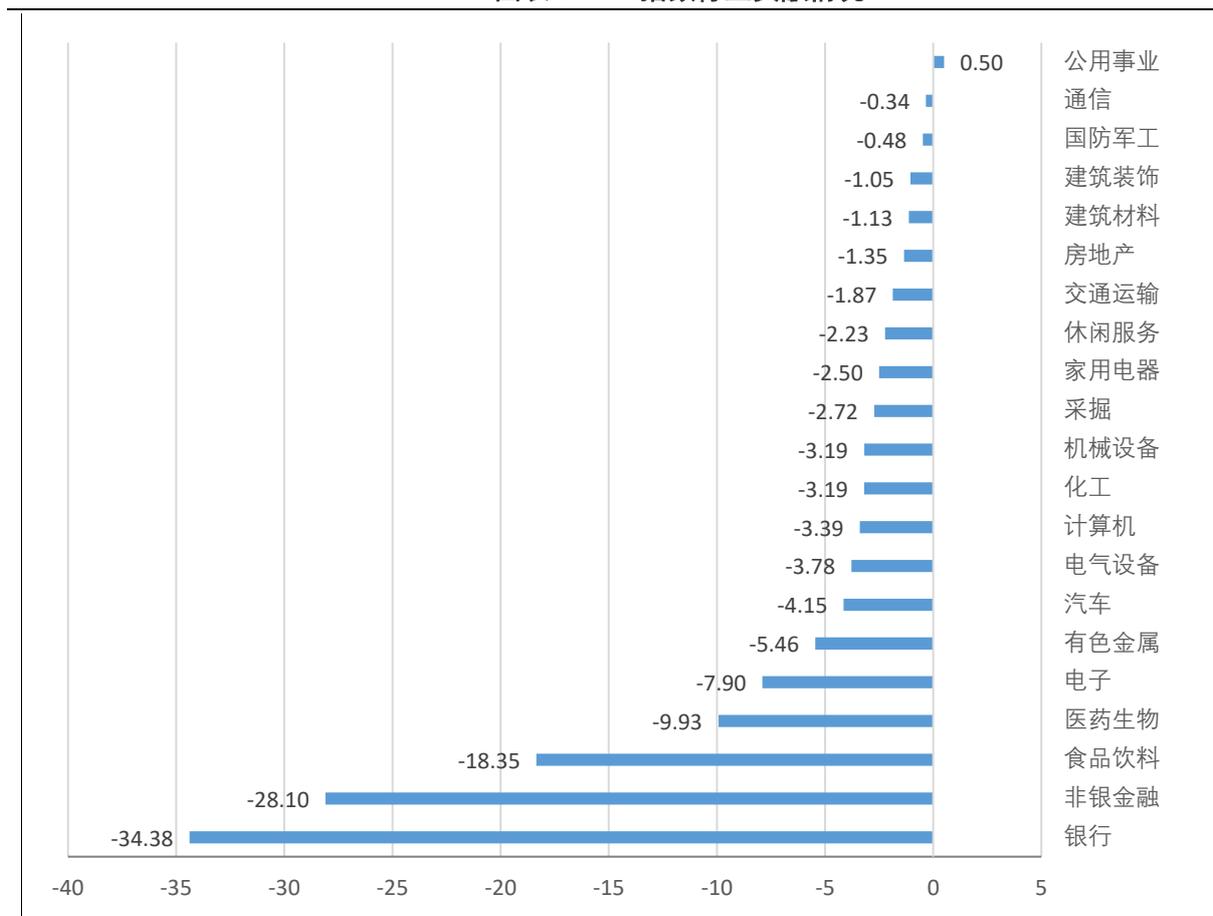
图表 2: IF 指数正/负贡献最大公司

	负贡献		正贡献	
	公司简称	点数	公司简称	点数
1	招商银行	-63.54	隆基绿能	65.38
2	中国中免	-54.01	恩捷股份	63.27
3	东方财富	-47.05	立讯精密	56.20
4	长江电力	-46.19	牧原股份	48.93
5	中国船舶	-41.66	阳光电源	45.91
6	恒瑞医药	-39.74	通威股份	45.80
7	紫金矿业	-31.91	五粮液	43.53
8	紫光国微	-31.01	比亚迪	43.17
9	中兴通讯	-30.99	东方雨虹	41.73
10	京东方A	-28.42	赣锋锂业	40.22

数据来源: wind, 兴证期货研发部

2022年7月18日至7月22日, 上证50指数下跌1.55点。在上证50指数的50只成分股中, 有36只股票对指数下跌提供负贡献, 有14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、中国中免、长江电力、恒瑞医药、紫金矿业; 对指数周度跌幅提供贡献点分别为: -0.37点, -0.32点, -0.27点, -0.24点, -0.19点。对IH指数周度跌幅提供正贡献排名前五的股票分别为: 隆基绿能、通威股份、中国神华、药明康德、万华化学; 对指数周度跌幅提供贡献点分别为: 0.39点, 0.27点, 0.2点, 0.17点, 0.16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

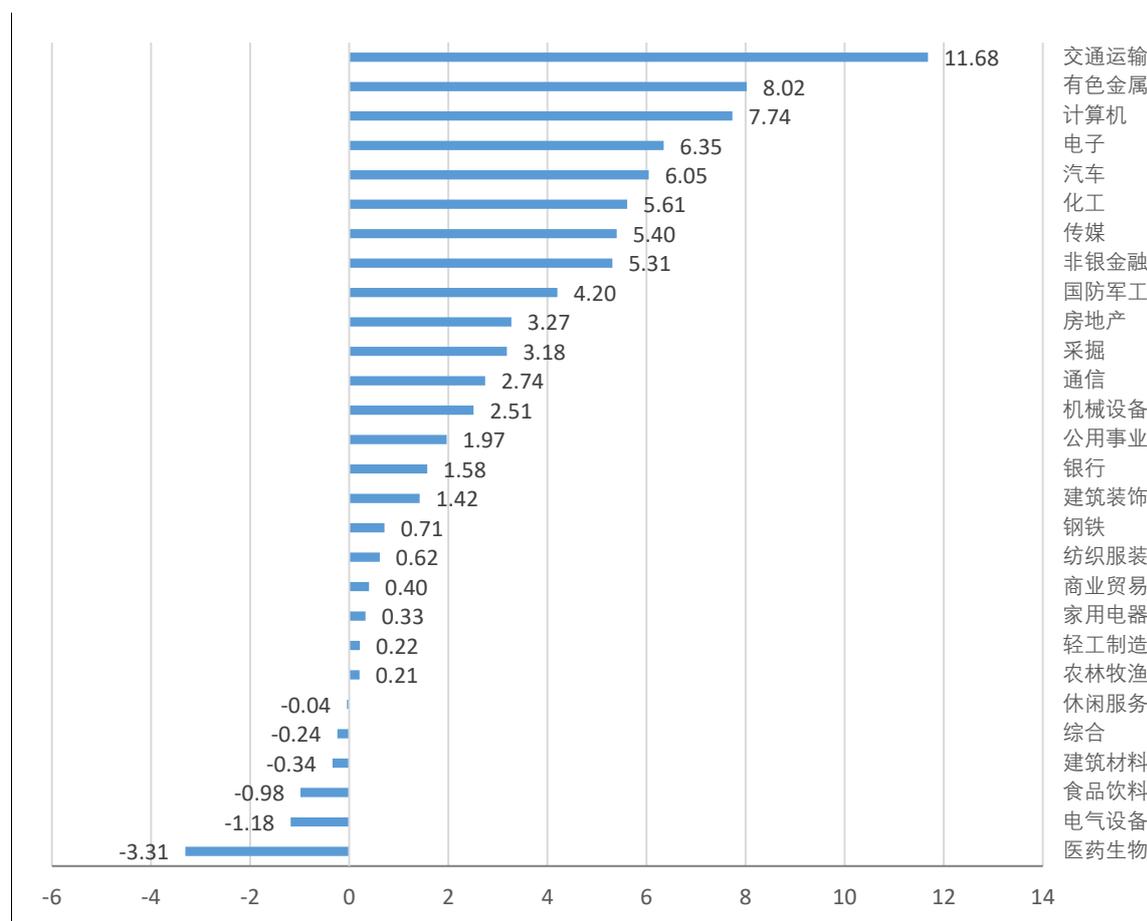
图表 4: IH 指数正/负贡献最大公司

	负贡献		正贡献	
	公司简称	点数	公司简称	点数
1	招商银行	-0.37	隆基绿能	0.39
2	中国中免	-0.32	通威股份	0.27
3	长江电力	-0.27	中国神华	0.20
4	恒瑞医药	-0.24	药明康德	0.17
5	紫金矿业	-0.19	万华化学	0.16
6	海通证券	-0.17	中国建筑	0.14
7	中国平安	-0.14	片仔癀	0.09
8	农业银行	-0.13	兆易创新	0.07
9	伊利股份	-0.12	海螺水泥	0.07
10	中信证券	-0.11	兴业银行	0.06

数据来源: wind, 兴证期货研发部

2022年7月18日至7月22日，中证500指数上涨73.43点。在中证500指数的500只成分股中，有131只股票对指数上涨提供负贡献，有365只股票提供正贡献，有4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：医药生物、电气设备、食品饮料；对IC指数周度涨幅提供正贡献排名前三的行业分别为：交通运输、有色金属、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：明阳智能、博腾股份、中天科技、九洲药业、兴发集团；对指数周度涨幅提供贡献点分别为：-2.63点，-1.08点，-0.96点，-0.86点，-0.85点。对IC指数周度涨幅提供正贡献排名前五的股票分别为：中远海能、招商轮船、攀钢钒钛、格林美、中际旭创；对指数周度涨幅提供贡献点分别为：3.12点，3.03点，2.64点，1.82点，1.58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	明阳智能	-2.63	中远海能	3.12
2	博腾股份	-1.08	招商轮船	3.03
3	中天科技	-0.96	攀钢钒钛	2.64
4	九洲药业	-0.86	格林美	1.82
5	兴发集团	-0.85	中际旭创	1.58
6	纳思达	-0.84	厦门钨业	1.46
7	我武生物	-0.81	广宇发展	1.40
8	建发股份	-0.67	中国化学	1.38
9	新宙邦	-0.66	圆通速递	1.34
10	鲁西化工	-0.61	中国卫星	1.18

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18日至7月22日, 北上资金净流出37.36亿元, 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13.79亿元。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20.26亿元, 其中买入360.28亿元, 卖出340.02亿元; 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17.61亿元, 其中买入150.07亿元, 卖出132.46亿元; 中证500指数500只成分股中有2只股票有北上资金参与, 周内净卖出1.33亿元, 其中买入16.59亿元, 卖出17.93亿元。

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
603799.SH	华友钴业	0.52	10.87	16.96	6.68	10.28
002466.SZ	天齐锂业	0.54	35.69	25.38	18.50	6.88
600438.SH	通威股份	0.66	45.80	22.44	16.26	6.18
002812.SZ	恩捷股份	0.64	63.27	6.75	1.63	5.12
300760.SZ	迈瑞医疗	0.80	40.12	12.97	8.27	4.69
600309.SH	万华化学	0.71	27.55	10.03	5.34	4.69
600031.SH	三一重工	0.54	-8.85	5.50	1.29	4.21
002371.SZ	北方华创	0.39	11.82	5.57	1.67	3.91
600036.SH	招商银行	2.67	-63.54	13.90	10.37	3.52
603501.SH	韦尔股份	0.46	-3.30	6.82	3.59	3.23
600519.SH	贵州茅台	6.10	9.02	36.39	33.95	2.44
300750.SZ	宁德时代	3.23	6.99	39.97	38.26	1.71
603259.SH	药明康德	1.04	28.35	7.39	5.80	1.59
000858.SZ	五粮液	1.80	43.53	9.91	8.44	1.47
002352.SZ	顺丰控股	0.56	-26.79	3.88	2.55	1.33
601888.SH	中国中免	0.93	-54.01	13.62	12.29	1.33
002460.SZ	赣锋锂业	0.51	40.22	8.69	7.58	1.11
688008.SH	澜起科技	0.16	-5.73	2.76	2.11	0.66
002709.SZ	天赐材料	0.25	18.44	2.61	2.16	0.45
002714.SZ	牧原股份	0.72	48.93	2.85	2.68	0.17
300059.SZ	东方财富	1.31	-47.05	12.36	12.61	-0.25
600809.SH	山西汾酒	0.72	-4.97	2.16	2.47	-0.31
000333.SZ	美的集团	1.44	3.31	2.45	3.21	-0.76
601012.SH	隆基绿能	1.85	65.38	23.12	24.40	-1.29
600887.SH	伊利股份	1.02	-19.74	4.53	6.32	-1.79
300014.SZ	亿纬锂能	0.53	24.62	5.50	7.33	-1.84
601877.SH	正泰电器	0.21	12.66	1.49	4.26	-2.77
600900.SH	长江电力	1.50	-46.19	3.45	6.38	-2.92
002050.SZ	三花智控	0.17	9.38	1.63	4.76	-3.13
600276.SH	恒瑞医药	0.73	-39.74	0.74	4.01	-3.27
000625.SZ	长安汽车	0.30	6.57	4.59	8.09	-3.50
300274.SZ	阳光电源	0.46	45.91	18.46	24.11	-5.65
002594.SZ	比亚迪	1.48	43.17	23.71	31.18	-7.47
000001.SZ	平安银行	0.74	12.89	1.71	11.48	-9.78

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
600438.SH	通威股份	1.77	0.27	22.44	16.26	6.18
600309.SH	万华化学	1.91	0.16	10.03	5.34	4.69
600031.SH	三一重工	1.46	-0.05	5.50	1.29	4.21
600036.SH	招商银行	7.12	-0.37	13.90	10.37	3.52
603501.SH	韦尔股份	1.24	-0.02	6.82	3.59	3.23
600519.SH	贵州茅台	16.42	0.05	36.39	33.95	2.44
603259.SH	药明康德	2.83	0.17	7.39	5.80	1.59
601888.SH	中国中免	2.50	-0.32	13.62	12.29	1.33
600809.SH	山西汾酒	1.93	-0.03	2.16	2.47	-0.31
601012.SH	隆基绿能	4.97	0.39	23.12	24.40	-1.29
600887.SH	伊利股份	2.82	-0.12	4.53	6.32	-1.79
600900.SH	长江电力	3.96	-0.27	3.45	6.38	-2.92
600276.SH	恒瑞医药	1.97	-0.24	0.74	4.01	-3.27

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	-2.63	9.23	9.74	-0.51
600522.SH	中天科技	0.85	-0.96	7.37	8.19	-0.82

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。