

成分股监测报告

2022年8月17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

2022年8月8日至8月12日，沪深300指数上涨49.04点。对IF指数周度涨幅提供负贡献排名前三的行业分别为：汽车、农林牧渔、计算机；对IF指数周度涨幅提供正贡献排名前三的行业分别为：非银金融、基础化工、煤炭。上证50指数上涨34.57点。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、医药生物、商贸零售；对IH指数周度涨幅提供正贡献排名前三的行业分别为：非银金融、电力设备、基础化工。中证500指数上涨154.29点。对IC指数周度涨幅提供负贡献排名前三的行业分别为：计算机、钢铁、汽车；对IC指数周度涨幅提供正贡献排名前三的行业分别为：非银金融、电力设备、基础化工。中证1000指数上涨146.3点。对IC指数周度涨幅提供负贡献排名前三的行业分别为：农林牧渔、综合、银行；对IM指数周度涨幅提供正贡献排名前三的行业分别为：基础化工、电子、机械设备。

北上资金净流入76.50亿元，周内合计净流入7.02亿元。在每日前十大活跃股中，沪深300指数300只成分股中有35只股票有北上资金参与，周内北上资金净买入9.94亿元，其中买入362.88亿元，卖出352.93亿元；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12.97亿元，其中买入164.04亿元，卖出151.07亿元；中证500指数500只成分股中有3只股票有北上资金参与，周内净卖出4.9亿元，其中买入12.73亿元，卖出17.63亿元。

报告目录

1. 成分股指数拉动情况.....	3
2. 北上资金个股流向.....	9

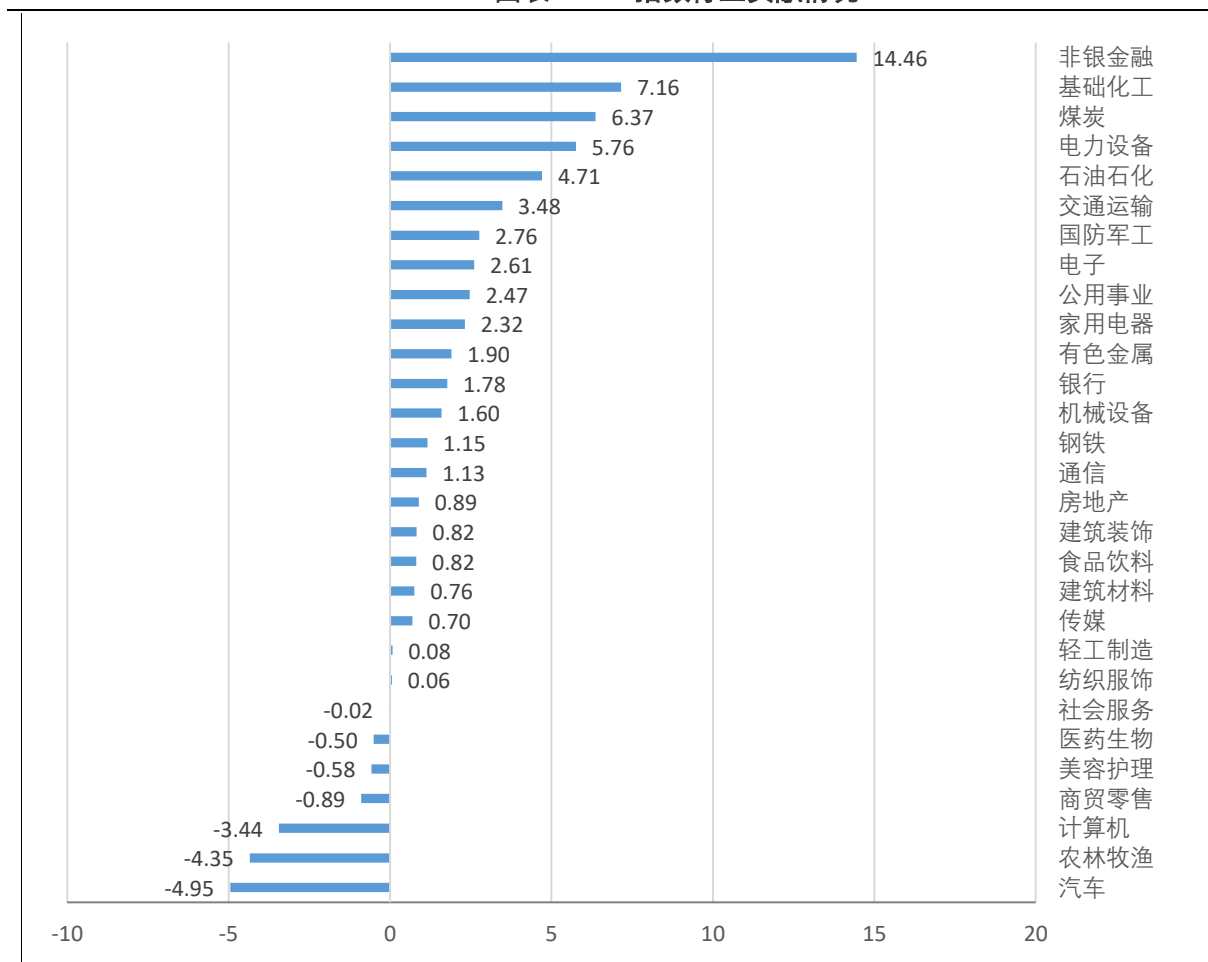
图表目录

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: IM 指数行业贡献情况.....	8
图表 8: IM 指数正/负贡献最大公司.....	8
图表 9: IF 北上资金流入情况.....	10
图表 10: IH 北上资金流入情况.....	11
图表 11: IC 北上资金流入情况.....	11
图表 12: IM 北上资金流入情况.....	11

1. 成分股指数拉动情况

2022年8月8日至8月12日，沪深300指数上涨49.04点。在沪深300指数的300只成分股中，有97只股票对指数上涨提供负贡献，有199只股票提供正贡献，有4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：汽车、农林牧渔、计算机；对IF指数周度涨幅提供正贡献排名前三的行业分别为：非银金融、基础化工、煤炭。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：比亚迪、牧原股份、德赛西威、温氏股份、宁德时代；对指数周度涨幅提供贡献点分别为：-3.19点，-2.05点，-1.85点，-1.51点，-1.46点。对IF指数周度涨幅提供正贡献排名前五的股票分别为：东方财富、隆基绿能、立讯精密、陕西煤业、阳光电源；对指数周度涨幅提供贡献点分别为：3.59点，3.45点，3.08点，2.68点，2.53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

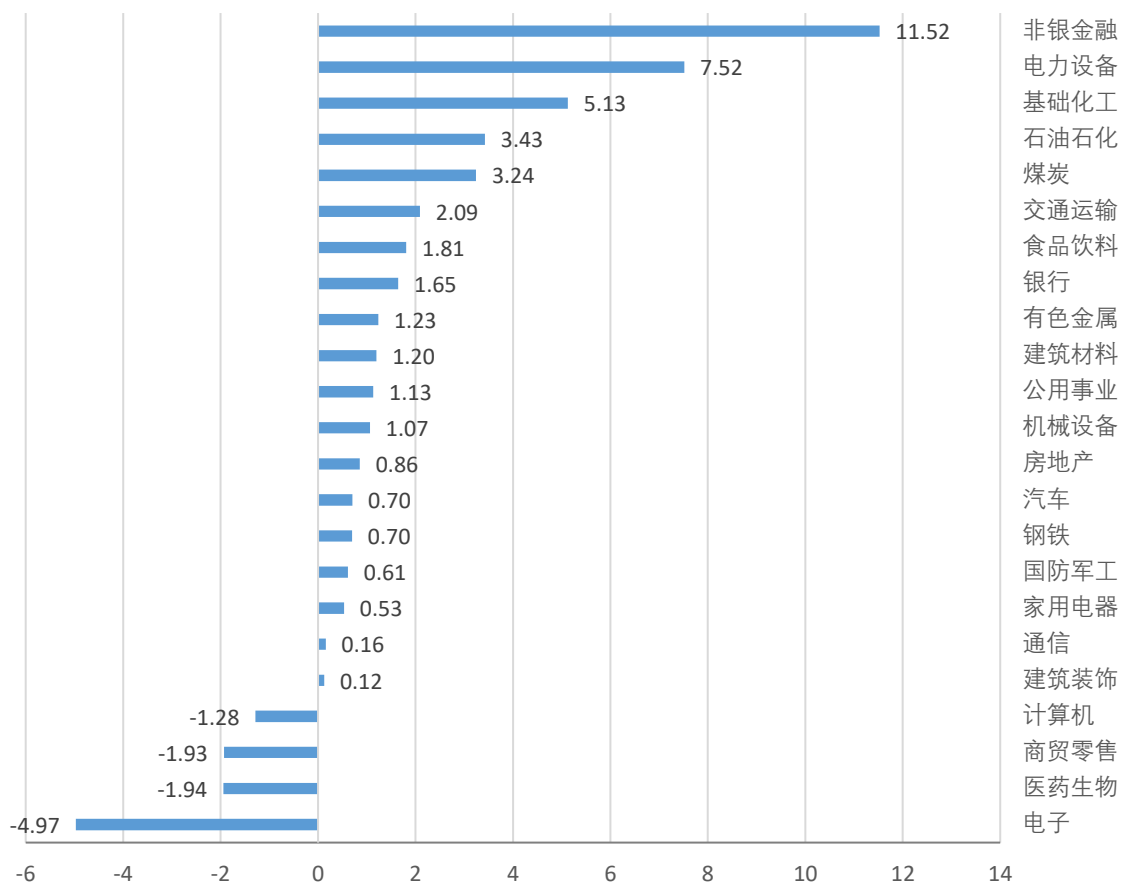
图表 2: IF 指数正/负贡献最大公司

	负贡献		正贡献	
	公司简称	点数	公司简称	点数
1	比亚迪	-3.19	东方财富	3.59
2	牧原股份	-2.05	隆基绿能	3.45
3	德赛西威	-1.85	立讯精密	3.08
4	温氏股份	-1.51	陕西煤业	2.68
5	宁德时代	-1.46	阳光电源	2.53
6	海天味业	-1.26	万华化学	2.51
7	长安汽车	-1.05	中信证券	2.14
8	爱尔眼科	-1.04	兖矿能源	1.70
9	闻泰科技	-0.96	歌尔股份	1.64
10	中国中免	-0.95	中国神华	1.59

数据来源: wind, 兴证期货研发部

2022年8月8日至8月12日, 上证50指数上涨34.57点。在上证50指数的50只成分股中, 有13只股票对指数上涨提供负贡献, 有37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、医药生物、商贸零售; 对IH指数周度涨幅提供正贡献排名前三的行业分别为: 非银金融、电力设备、基础化工。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: 海天味业、闻泰科技、中国中免、华友钴业、韦尔股份; 对指数周度涨幅提供贡献点分别为: -2.57点, -1.97点, -1.93点, -1.9点, -1.82点。对IH指数周度涨幅提供正贡献排名前五的股票分别为: 隆基绿能、万华化学、中信证券、中国神华、紫金矿业; 对指数周度涨幅提供贡献点分别为: 7.04点, 5.13点, 4.36点, 3.24点, 3.12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

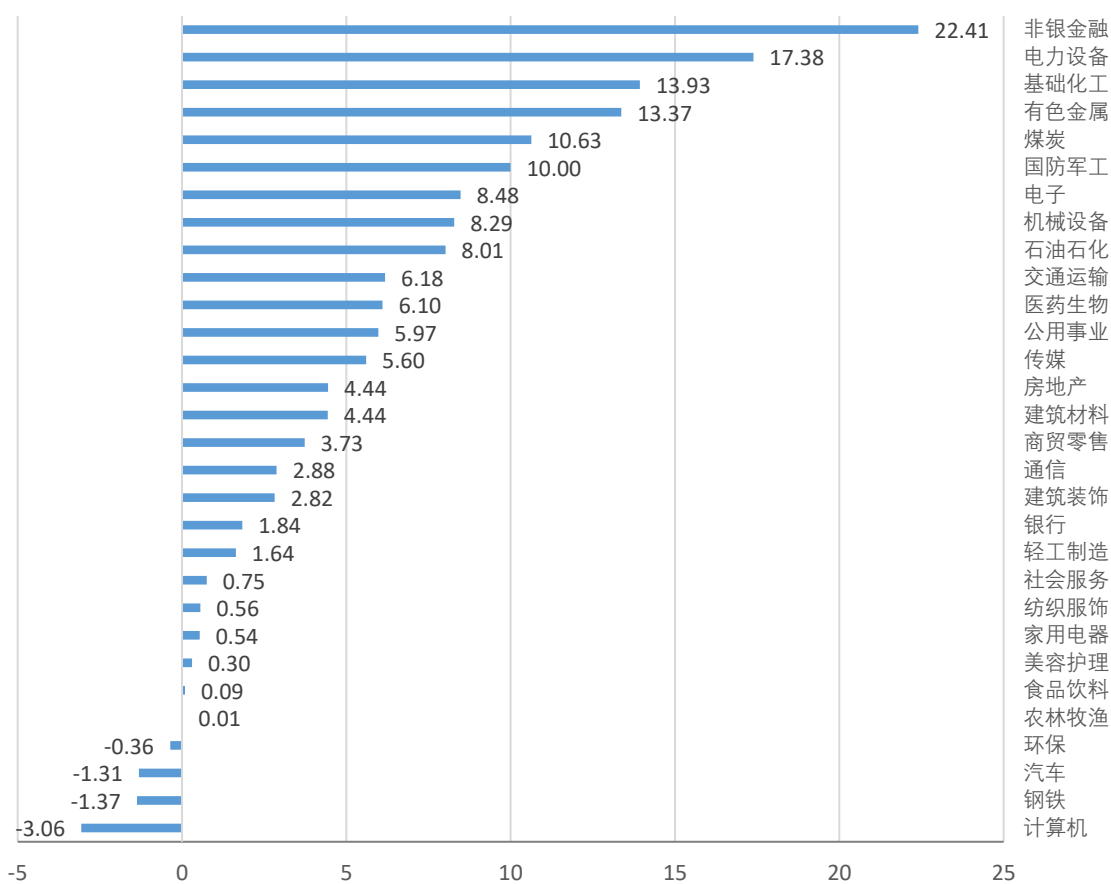
图表 4: IH 指数正/负贡献最大公司

	负贡献		正贡献	
	公司简称	点数	公司简称	点数
1	海天味业	-2.57	隆基绿能	7.04
2	闻泰科技	-1.97	万华化学	5.13
3	中国中免	-1.93	中信证券	4.36
4	华友钴业	-1.90	中国神华	3.24
5	韦尔股份	-1.82	紫金矿业	3.12
6	恒瑞医药	-1.41	兴业银行	2.29
7	兆易创新	-1.19	山西汾酒	2.17
8	药明康德	-1.16	中远海控	2.09
9	恒生电子	-0.74	恒力石化	1.78
10	工商银行	-0.61	华泰证券	1.70

数据来源: wind, 兴证期货研发部

2022年8月8日至8月12日，中证500指数上涨154.29点。在中证500指数的500只成分股中，有93只股票对指数上涨提供负贡献，有401只股票提供正贡献，有6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：计算机、钢铁、汽车；对IC指数周度涨幅提供正贡献排名前三的行业分别为：非银金融、电力设备、基础化工。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：卫士通、抚顺特钢、攀钢钒钛、景嘉微、均胜电子；对指数周度涨幅提供贡献点分别为：-2.85点，-2.65点，-2.53点，-2.03点，-1.63点。对IC指数周度涨幅提供正贡献排名前五的股票分别为：广汇能源、爱旭股份、中国宝安、通富微电、国元证券；对指数周度涨幅提供贡献点分别为：6.29点，4.95点，4.92点，3.49点，3.41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

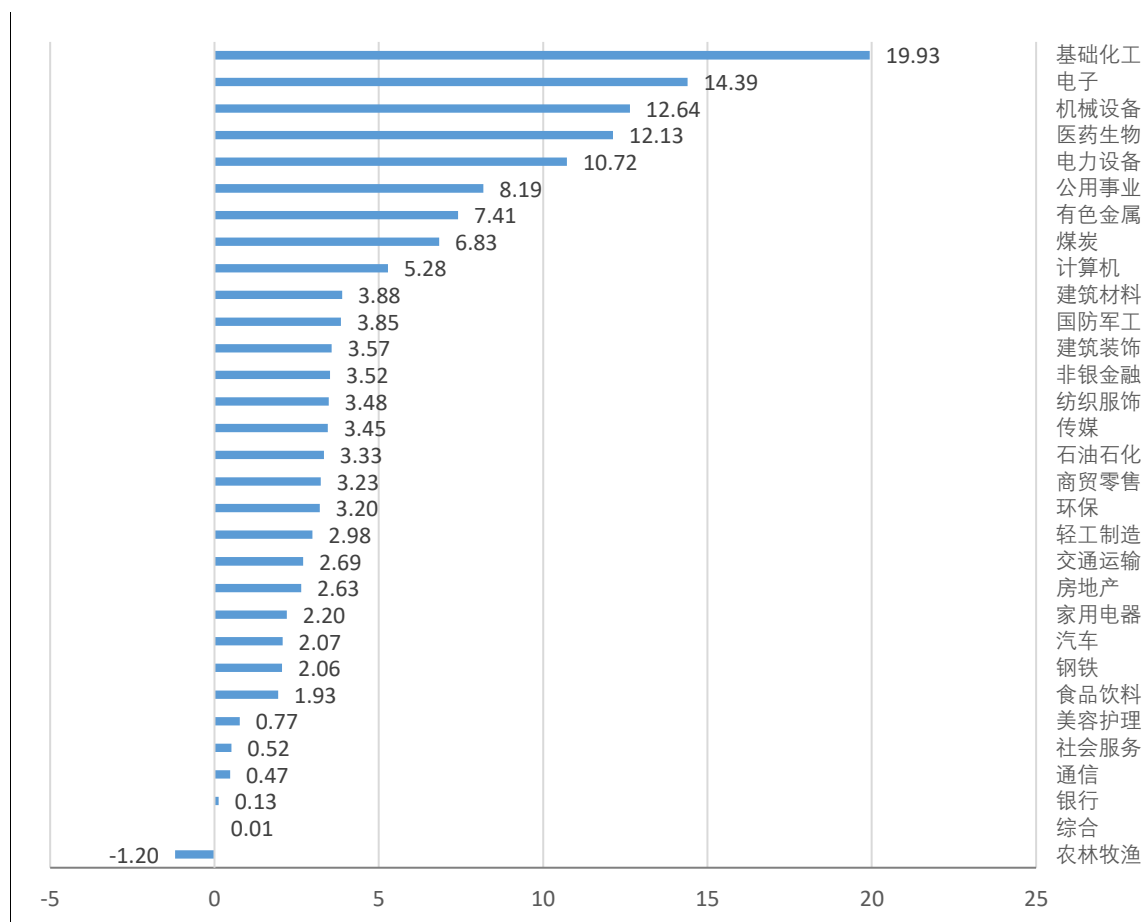
图表 6: IC 指数正/负贡献最大公司

	负贡献		正贡献	
	公司简称	点数	公司简称	点数
1	卫士通	-2.85	广汇能源	6.29
2	抚顺特钢	-2.65	爱旭股份	4.95
3	攀钢钒钛	-2.53	中国宝安	4.92
4	景嘉微	-2.03	通富微电	3.49
5	均胜电子	-1.63	国元证券	3.41
6	益丰药房	-1.57	中兵红箭	3.26
7	宏发股份	-1.55	山煤国际	2.92
8	法拉电子	-1.41	赤峰黄金	2.78
9	柏楚电子	-1.34	中直股份	2.72
10	伟明环保	-1.10	新宙邦	2.61

数据来源: wind, 兴证期货研发部

2022年8月8日至8月12日, 中证1000指数上涨146.3点。在中证1000指数的1000只成分股中, 有269只股票对指数上涨提供负贡献, 有724只股票提供正贡献, 有7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: 农林牧渔、综合、银行; 对IC指数周度涨幅提供正贡献排名前三的行业分别为: 基础化工、电子、机械设备。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: 星源材质、融捷股份、湘电股份、科达利、万业企业; 对指数周度涨幅提供贡献点分别为: -2.75点, -2.63点, -1.72点, -1.62点, -1.61点。对IC指数周度涨幅提供正贡献排名前五的股票分别为: 神火股份、中信博、西藏城投、黄河旋风、海优新材; 对指数周度涨幅提供贡献点分别为: 4.07点, 2.7点, 2.55点, 2.36点, 2.26点。

图表 7: IM 指数行业贡献情况



数据来源: wind, 兴证期货研发部

图表 8: IM 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	星源材质	-2.75	神火股份	4.07
2	融捷股份	-2.63	中信博	2.70
3	湘电股份	-1.72	西藏城投	2.55
4	科达利	-1.62	黄河旋风	2.36
5	万业企业	-1.61	海优新材	2.26
6	天奈科技	-1.55	菲利华	2.15
7	中望软件	-1.24	大金重工	1.99
8	移远通信	-1.19	皖维高新	1.97
9	新洁能	-1.06	中来股份	1.96
10	双环传动	-1.05	中国黄金	1.95

数据来源: wind, 兴证期货研发部

2. 北上资金个股流向

2022年8月8日至8月12日，北上资金净流入76.50亿元，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7.02亿元。在每日前十大活跃股中，沪深300指数300只成分股中有35只股票有北上资金参与，周内北上资金净买入9.94亿元，其中买入362.88亿元，卖出352.93亿元；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12.97亿元，其中买入164.04亿元，卖出151.07亿元；中证500指数500只成分股中有3只股票有北上资金参与，周内净卖出4.9亿元，其中买入12.73亿元，卖出17.63亿元。

图表 9: 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
601012.SH	隆基绿能	1.91	3.45	35.07	16.04	19.03
002594.SZ	比亚迪	1.49	-3.19	26.18	18.15	8.03
600519.SH	贵州茅台	6.11	0.71	30.64	23.24	7.40
300014.SZ	亿纬锂能	0.55	-0.08	8.25	3.52	4.73
603501.SH	韦尔股份	0.38	-0.89	13.44	9.07	4.38
300059.SZ	东方财富	1.21	3.59	11.03	6.72	4.31
603806.SH	福斯特	0.19	0.98	6.07	2.45	3.62
600887.SH	伊利股份	0.94	0.37	4.67	1.41	3.26
002241.SZ	歌尔股份	0.39	1.64	9.66	7.20	2.45
603290.SH	斯达半导	0.14	-0.43	3.61	1.21	2.40
002812.SZ	恩捷股份	0.59	-0.40	8.02	5.64	2.38
600030.SH	中信证券	0.98	2.14	5.30	3.15	2.16
002920.SZ	德赛西威	0.28	-1.85	3.74	1.71	2.03
688111.SH	金山办公	0.17	-0.64	3.12	1.22	1.90
002049.SZ	紫光国微	0.46	1.48	3.96	2.23	1.73
300750.SZ	宁德时代	3.65	-1.46	26.16	24.48	1.69
002475.SZ	立讯精密	0.86	3.08	15.74	14.08	1.66
600036.SH	招商银行	2.22	0.25	15.14	13.88	1.26
603259.SH	药明康德	0.98	-0.57	8.86	7.67	1.19
688599.SH	天合光能	0.46	1.37	2.33	1.49	0.84
601318.SH	中国平安	2.34	0.22	2.78	2.08	0.71
601888.SH	中国中免	1.05	-0.95	17.55	17.11	0.44
000625.SZ	长安汽车	0.47	-1.05	1.88	2.74	-0.86
002460.SZ	赣锋锂业	0.51	0.23	1.97	4.21	-2.24
603799.SH	华友钴业	0.55	-0.93	1.99	4.43	-2.44
002709.SZ	天赐材料	0.36	1.23	3.43	7.10	-3.67
600309.SH	万华化学	0.67	2.51	1.87	5.63	-3.76
601899.SH	紫金矿业	0.66	1.53	10.14	14.94	-4.80
300274.SZ	阳光电源	0.66	2.53	13.04	17.87	-4.83
002371.SZ	北方华创	0.34	0.52	19.91	24.83	-4.92
002466.SZ	天齐锂业	0.61	-0.51	20.90	25.89	-4.98
002129.SZ	TCL中环	0.59	-0.09	3.94	10.06	-6.11
600089.SH	特变电工	0.49	-0.23	3.32	9.65	-6.33
002050.SZ	三花智控	0.30	0.97	2.56	9.43	-6.86
600438.SH	通威股份	0.75	0.24	16.58	32.43	-15.84

数据来源: wind, 兴证期货研发部

图表 10: 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	5.35	7.04	35.07	16.04	19.03
600519.SH	贵州茅台	17.12	1.45	30.64	23.24	7.40
603501.SH	韦尔股份	1.07	-1.82	13.44	9.07	4.38
600887.SH	伊利股份	2.63	0.76	4.67	1.41	3.26
600030.SH	中信证券	2.75	4.36	5.30	3.15	2.16
600036.SH	招商银行	6.23	0.51	15.14	13.88	1.26
603259.SH	药明康德	2.75	-1.16	8.86	7.67	1.19
601318.SH	中国平安	6.55	0.44	2.78	2.08	0.71
601888.SH	中国中免	2.94	-1.93	17.55	17.11	0.44
603799.SH	华友钴业	1.54	-1.90	1.99	4.43	-2.44
600309.SH	万华化学	1.89	5.13	1.87	5.63	-3.76
601899.SH	紫金矿业	1.85	3.12	10.14	14.94	-4.80
600438.SH	通威股份	2.09	0.48	16.58	32.43	-15.84

数据来源: wind, 兴证期货研发部

图表 11: 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
600988.SH	赤峰黄金	0.38	2.78	2.82	1.45	1.37
600522.SH	中天科技	0.98	1.73	1.49	3.80	-2.31
300724.SZ	捷佳伟创	0.50	1.79	8.43	12.38	-3.95

数据来源: wind, 兴证期货研发部

图表 12: IM 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
688200.SH	华峰测控	0.15	1.05	3.03	2.07	0.96

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。