

成分股监测报告

2022年8月31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22日至8月26日，沪深300指数下跌27.62点。对IF指数周度跌幅提供负贡献排名前三的行业分别为：电力设备、电子、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：食品饮料、非银金融、煤炭。上证50指数上涨14.19点。对IH指数周度涨幅提供负贡献排名前三的行业分别为：电力设备、电子、医药生物；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、食品饮料、基础化工。中证500指数下跌82.97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、电力设备、国防军工；对IC指数周度跌幅提供正贡献排名前三的行业分别为：农林牧渔、煤炭、石油石化。中证1000指数下跌234.3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、电力设备、机械设备；对IM指数周度跌幅提供正贡献排名前三的行业分别为：交通运输、煤炭、农林牧渔。

北上资金净流出46.96亿元，周内合计净流入17.22亿元。在每日前十大活跃股中，沪深300指数300只成分股中有32只股票有北上资金参与，周内北上资金净买入19.48亿元，其中买入428.27亿元，卖出408.79亿元；上证50指数50只成分股中有16只股票有北上资金参与，周内净买入13.96亿元，其中买入200.98亿元，卖出187.01亿元；中证500指数500只成分股中有4只股票有北上资金参与，周内净买入1.73亿元，其中买入10.89亿元，卖出9.16亿元。

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

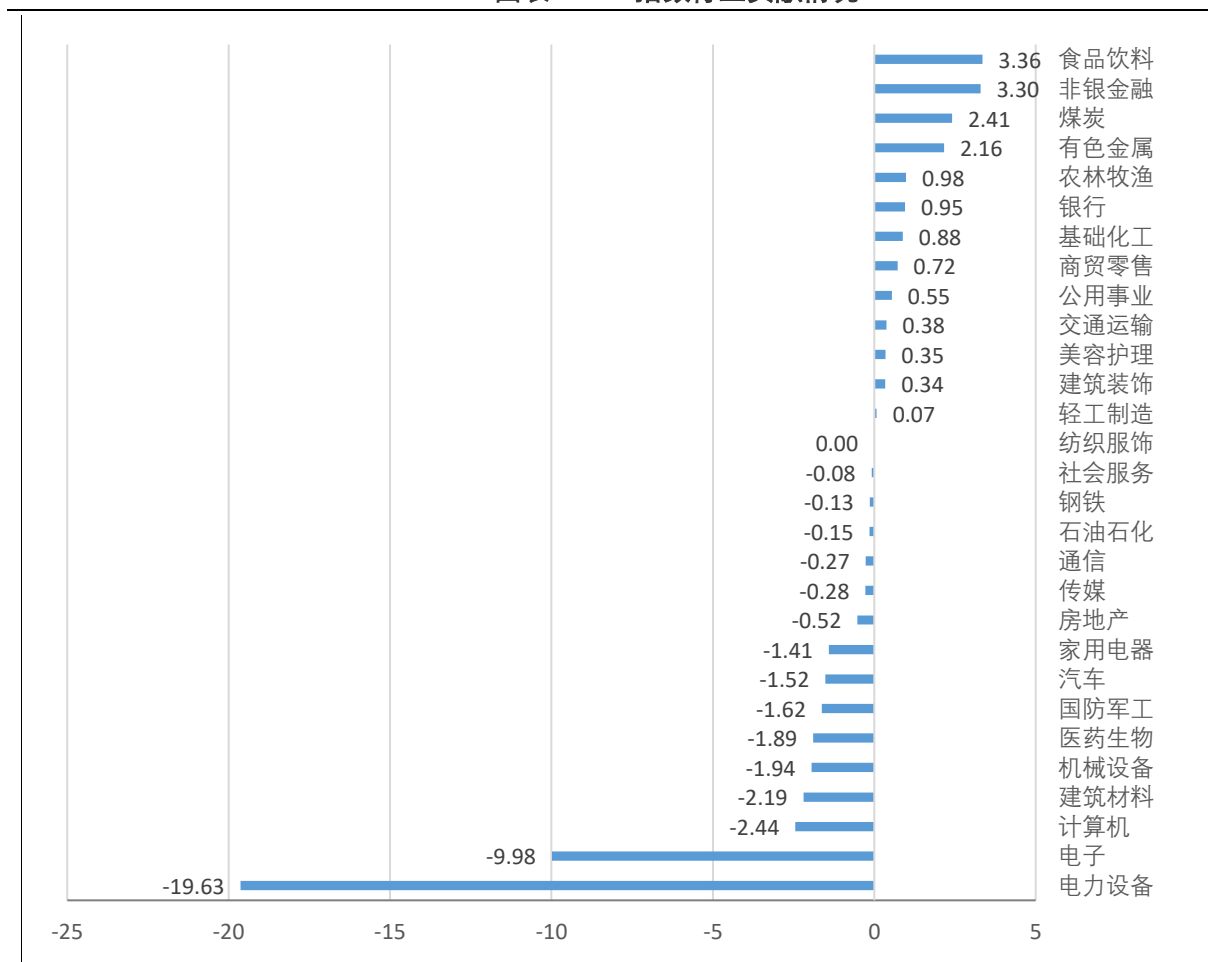
图表目录

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22日至8月26日，沪深300指数下跌27.62点。在沪深300指数的300只成分股中，有189只股票对指数下跌提供负贡献，有107只股票提供正贡献，有4只股票贡献为0。分行业看，对IF指数周度跌幅提供负贡献排名前三的行业分别为：电力设备、电子、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：食品饮料、非银金融、煤炭。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：宁德时代、隆基绿能、东方雨虹、韦尔股份、亿纬锂能；对指数周度跌幅提供贡献点分别为：-5.23点，-3.15点，-1.87点，-1.47点，-1.42点。对IF指数周度跌幅提供正贡献排名前五的股票分别为：中国平安、山西汾酒、泸州老窖、天齐锂业、长城汽车；对指数周度跌幅提供贡献点分别为：3.71点，1.71点，1.21点，1.07点，1.03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

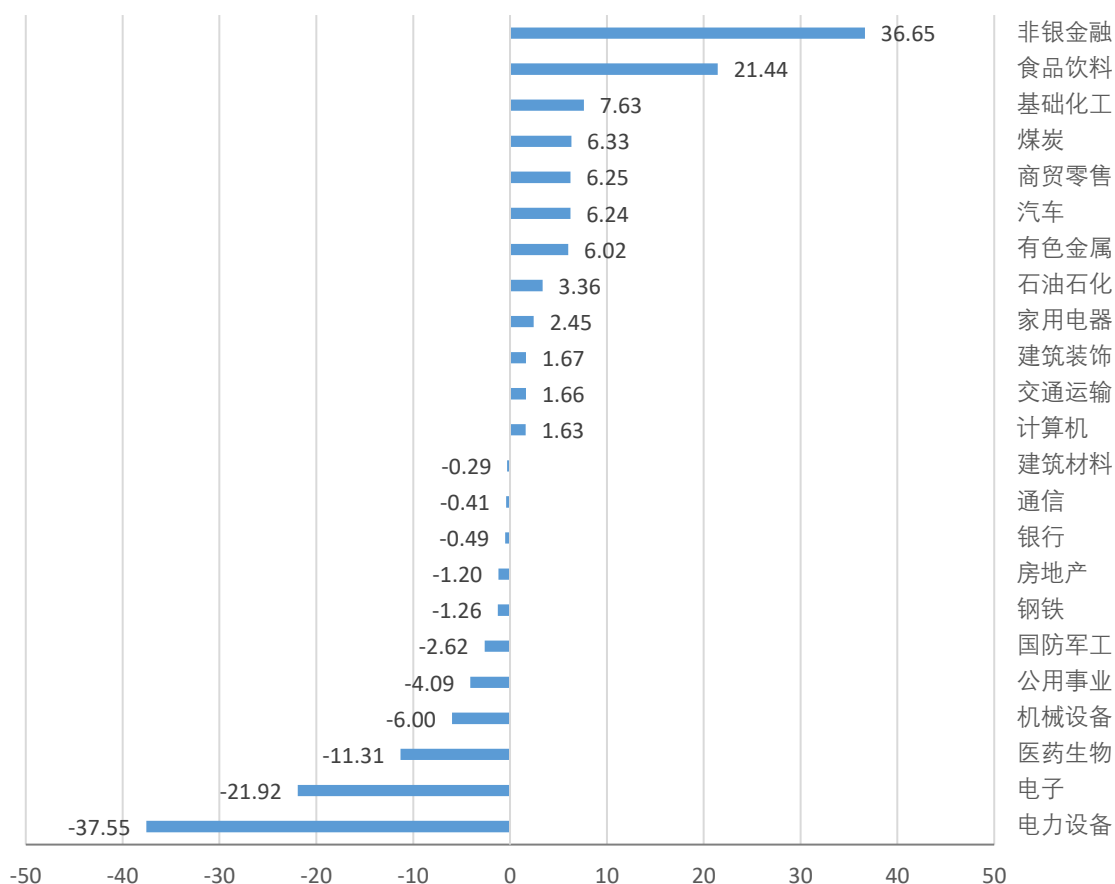
图表 2: IF 指数正/负贡献最大公司

	负贡献		正贡献	
	公司简称	点数	公司简称	点数
1	宁德时代	-5.23	中国平安	3.71
2	隆基绿能	-3.15	山西汾酒	1.71
3	东方雨虹	-1.87	泸州老窖	1.21
4	韦尔股份	-1.47	天齐锂业	1.07
5	亿纬锂能	-1.42	长城汽车	1.03
6	通威股份	-1.33	万华化学	0.91
7	五粮液	-1.10	立讯精密	0.91
8	长安汽车	-1.07	陕西煤业	0.85
9	阳光电源	-0.97	中国神华	0.75
10	京东方A	-0.92	中国中免	0.74

数据来源: wind, 兴证期货研发部

2022年8月22日至8月26日, 上证50指数上涨14.19点。在上证50指数的50只成分股中, 有26只股票对指数上涨提供负贡献, 有24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: 电力设备、电子、医药生物; 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、食品饮料、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: 隆基绿能、韦尔股份、通威股份、恒瑞医药、三一重工; 对指数周度涨幅提供贡献点分别为: -26.43点, -12.3点, -11.13点, -6.45点, -6点。对IH指数周度涨幅提供正贡献排名前五的股票分别为: 中国平安、山西汾酒、长城汽车、万华化学、中国神华; 对指数周度涨幅提供贡献点分别为: 31.13点, 14.37点, 8.59点, 7.63点, 6.33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

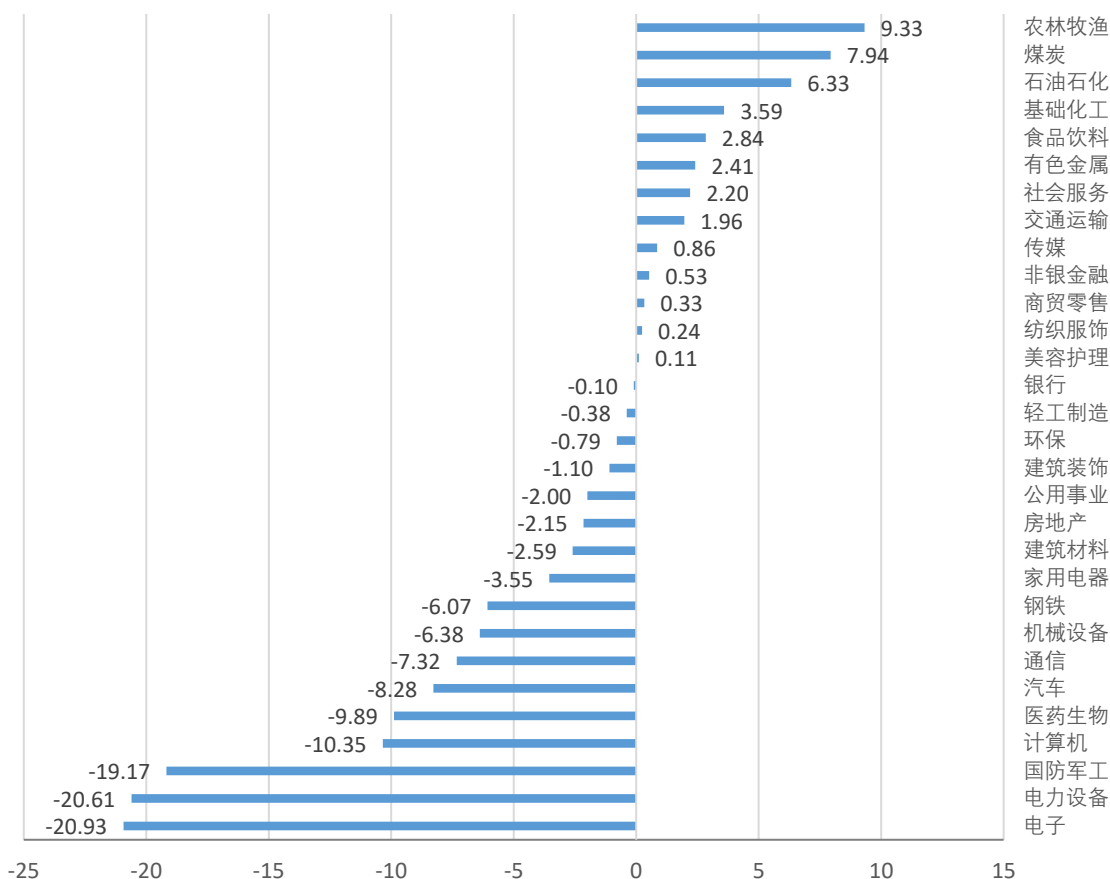
图表 4: IH 指数正/负贡献最大公司

	负贡献		正贡献	
	公司简称	点数	公司简称	点数
1	隆基绿能	-26.43	中国平安	31.13
2	韦尔股份	-12.30	山西汾酒	14.37
3	通威股份	-11.13	长城汽车	8.59
4	恒瑞医药	-6.45	万华化学	7.63
5	三一重工	-6.00	中国神华	6.33
6	闻泰科技	-5.83	中国中免	6.25
7	兆易创新	-3.78	紫金矿业	5.87
8	长江电力	-2.99	中国人寿	5.05
9	复星医药	-2.73	中国石油	3.30
10	航发动力	-2.62	伊利股份	2.73

数据来源: wind, 兴证期货研发部

2022年8月22日至8月26日，中证500指数下跌82.97点。在中证500指数的500只成分股中，有321只股票对指数下跌提供负贡献，有170只股票提供正贡献，有9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、电力设备、国防军工；对IC指数周度跌幅提供正贡献排名前三的行业分别为：农林牧渔、煤炭、石油石化。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：江淮汽车、捷佳伟创、明阳智能、东山精密、中天科技；对指数周度跌幅提供贡献点分别为：-4.13点，-3.98点，-3.25点，-2.77点，-2.67点。对IC指数周度跌幅提供正贡献排名前五的股票分别为：广汇能源、大北农、东方电气、天华超净、潞安环能；对指数周度跌幅提供贡献点分别为：6.11点，3.93点，2.81点，2.7点，2.59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

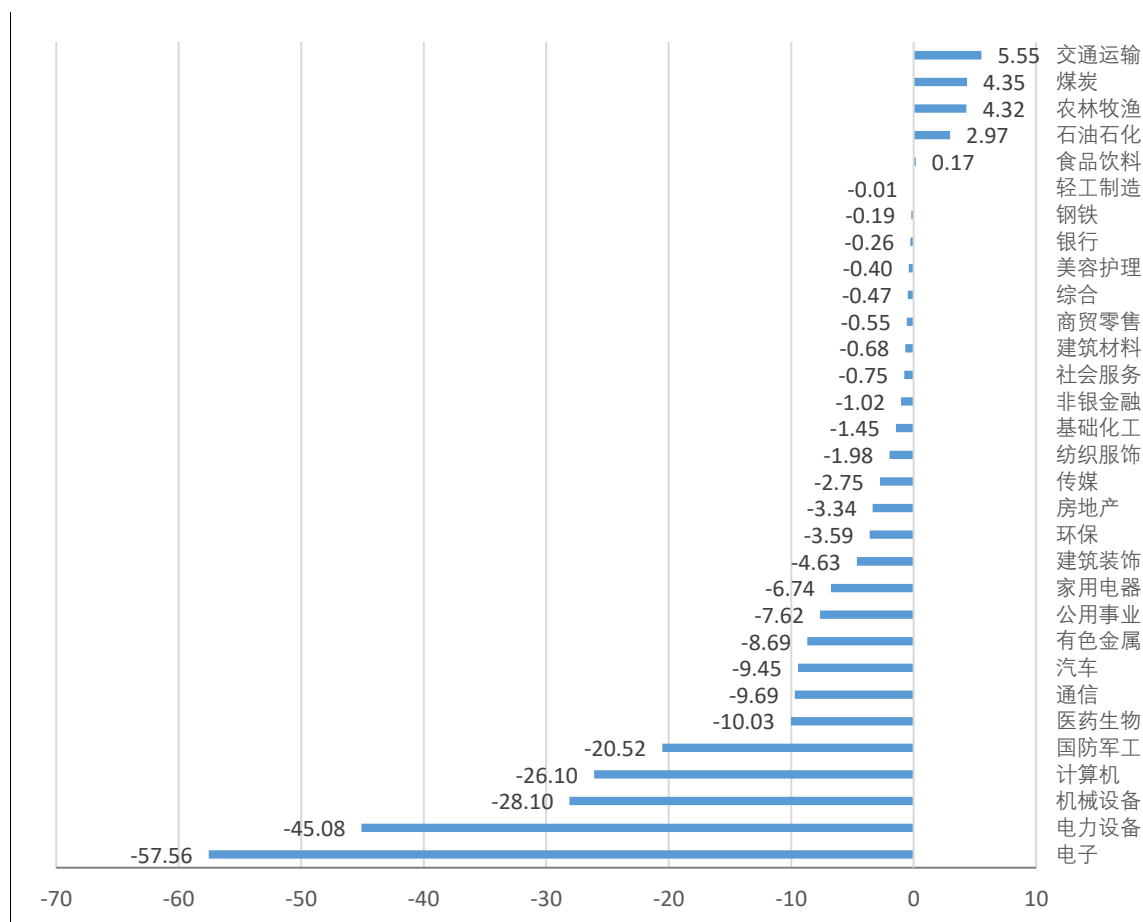
图表 6: IC 指数正/负贡献最大公司

	负贡献		正贡献	
	公司简称	点数	公司简称	点数
1	江淮汽车	-4.13	广汇能源	6.11
2	捷佳伟创	-3.98	大北农	3.93
3	明阳智能	-3.25	东方电气	2.81
4	东山精密	-2.77	天华超净	2.70
5	中天科技	-2.67	潞安环能	2.59
6	中国宝安	-2.54	山西焦煤	2.53
7	中航重机	-2.10	圣农发展	2.28
8	航天发展	-2.00	山煤国际	2.22
9	鸿远电子	-1.98	厦门钨业	1.93
10	攀钢钒钛	-1.98	安井食品	1.77

数据来源: wind, 兴证期货研发部

2022年8月22日至8月26日, 中证1000指数下跌234.3点。在中证1000指数的1000只成分股中, 有736只股票对指数下跌提供负贡献, 有258只股票提供正贡献, 有6只股票贡献为0。分行业看, 对IC指数周度跌幅提供负贡献排名前三的行业分别为: 电子、电力设备、机械设备; 对IC指数周度跌幅提供正贡献排名前三的行业分别为: 交通运输、煤炭、农林牧渔。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: 极米科技、双星新材、明泰铝业、绿的谐波、东方日升; 对指数周度跌幅提供贡献点分别为: -3.8点, -3.54点, -3.14点, -2.98点, -2.89点。对IC指数周度跌幅提供正贡献排名前五的股票分别为: 中矿资源、中远海特、晋控煤业、神火股份、融捷股份; 对指数周度跌幅提供贡献点分别为: 3.31点, 2.33点, 2.15点, 2.14点, 1.78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	极米科技	-3.80	中矿资源	3.31
2	双星新材	-3.54	中远海特	2.33
3	明泰铝业	-3.14	晋控煤业	2.15
4	绿的谐波	-2.98	神火股份	2.14
5	东方日升	-2.89	融捷股份	1.78
6	四维图新	-2.82	平煤股份	1.69
7	天顺风能	-2.65	西部创业	1.64
8	新洁能	-2.48	国机重装	1.56
9	兴森科技	-2.36	新潮能源	1.43
10	鹏辉能源	-2.20	湖北宜化	1.36

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22日至8月26日，北上资金净流出46.96亿元，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17.22亿元。在每日前十大活跃股中，沪深300指数300只成分股中有32只股票有北上资金参与，周内北上资金净买入19.48亿元，其中买入428.27亿元，卖出408.79亿元；上证50指数50只成分股中有16只股票有北上资金参与，周内净买入13.96亿元，其中买入200.98亿元，卖出187.01亿元；中证500指数500只成分股中有4只股票有北上资金参与，周内净买入1.73亿元，其中买入10.89亿元，卖出9.16亿元。

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
600438.SH	通威股份	0.75	-1.33	38.27	22.36	15.91
600519.SH	贵州茅台	6.11	0.29	38.12	29.87	8.25
002460.SZ	赣锋锂业	0.51	0.14	19.04	11.99	7.05
000625.SZ	长安汽车	0.47	-1.07	7.86	3.40	4.46
300760.SZ	迈瑞医疗	0.72	0.42	10.45	6.77	3.68
002812.SZ	恩捷股份	0.59	0.19	4.68	1.34	3.33
600887.SH	伊利股份	0.94	0.33	4.00	1.17	2.83
601318.SH	中国平安	2.34	3.71	16.09	13.58	2.51
603799.SH	华友钴业	0.55	0.18	7.50	5.36	2.14
300750.SZ	宁德时代	3.65	-5.23	56.23	54.10	2.13
600809.SH	山西汾酒	0.69	1.71	9.40	7.41	1.99
688599.SH	天合光能	0.46	-0.32	4.36	2.67	1.69
603501.SH	韦尔股份	0.38	-1.47	5.98	4.63	1.35
300124.SZ	汇川技术	0.63	-0.58	3.31	2.14	1.16
600309.SH	万华化学	0.67	0.91	5.89	5.08	0.81
002466.SZ	天齐锂业	0.61	1.07	33.21	32.50	0.72
002714.SZ	牧原股份	0.81	0.30	3.76	3.13	0.63
601899.SH	紫金矿业	0.66	0.70	2.18	1.57	0.61
603259.SH	药明康德	0.98	-0.28	10.46	10.54	-0.07
000568.SZ	泸州老窖	0.84	1.21	2.65	3.11	-0.46
002475.SZ	立讯精密	0.86	0.91	14.27	15.12	-0.85
601919.SH	中远海控	0.45	0.20	1.97	2.91	-0.94
300014.SZ	亿纬锂能	0.55	-1.42	18.97	20.08	-1.10
600900.SH	长江电力	1.39	-0.36	2.22	3.73	-1.51
600276.SH	恒瑞医药	0.81	-0.77	2.49	4.44	-1.94
601225.SH	陕西煤业	0.38	0.85	0.53	3.40	-2.87
600036.SH	招商银行	2.22	-0.30	12.38	16.35	-3.97
002594.SZ	比亚迪	1.49	-0.52	21.78	25.75	-3.97
300274.SZ	阳光电源	0.66	-0.97	18.38	22.73	-4.35
601888.SH	中国中免	1.05	0.74	9.51	14.11	-4.60
300059.SZ	东方财富	1.21	-0.81	7.83	13.56	-5.73
601012.SH	隆基绿能	1.91	-3.15	34.52	43.91	-9.39

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
600438.SH	通威股份	2.09	-11.13	38.27	22.36	15.91
600519.SH	贵州茅台	17.12	2.45	38.12	29.87	8.25
600887.SH	伊利股份	2.63	2.73	4.00	1.17	2.83
601318.SH	中国平安	6.55	31.13	16.09	13.58	2.51
603799.SH	华友钴业	1.54	1.55	7.50	5.36	2.14
600809.SH	山西汾酒	1.92	14.37	9.40	7.41	1.99
603501.SH	韦尔股份	1.07	-12.30	5.98	4.63	1.35
600309.SH	万华化学	1.89	7.63	5.89	5.08	0.81
601899.SH	紫金矿业	1.85	5.87	2.18	1.57	0.61
603259.SH	药明康德	2.75	-2.37	10.46	10.54	-0.07
601919.SH	中远海控	1.25	1.66	1.97	2.91	-0.94
600900.SH	长江电力	3.90	-2.99	2.22	3.73	-1.51
600276.SH	恒瑞医药	2.26	-6.45	2.49	4.44	-1.94
600036.SH	招商银行	6.23	-2.50	12.38	16.35	-3.97
601888.SH	中国中免	2.94	6.25	9.51	14.11	-4.60
601012.SH	隆基绿能	5.35	-26.43	34.52	43.91	-9.39

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
002240.SZ	盛新锂能	0.53	1.22	3.69	2.04	1.65
601699.SH	潞安环能	0.26	2.59	3.17	1.58	1.59
600256.SH	广汇能源	0.70	6.11	2.28	2.54	-0.27
688390.SH	固德威	0.33	-1.02	1.75	3.00	-1.24

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
688063.SH	派能科技	0.45	-1.84	2.92	2.91	0.01

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。