

成分股监测报告

2022年9月28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9月19日至9月23日，沪深300指数下跌72.4点。对IF指数周度跌幅提供负贡献排名前三的行业分别为：电子、医药生物、家用电器；对IF指数周度跌幅提供正贡献排名前三的行业分别为：电力设备、有色金属、石油石化。上证50指数下跌47.52点。对IH指数周度跌幅提供负贡献排名前三的行业分别为：医药生物、食品饮料、电子；对IH指数周度跌幅提供正贡献排名前三的行业分别为：石油石化、建筑装饰、电力设备。中证500指数下跌58.25点。对IC指数周度跌幅提供负贡献排名前三的行业分别为：医药生物、电子、计算机；对IC指数周度跌幅提供正贡献排名前三的行业分别为：有色金属、煤炭、交通运输。中证1000指数下跌104.71点。对IC指数周度跌幅提供负贡献排名前三的行业分别为：医药生物、电子、计算机；对IM指数周度跌幅提供正贡献排名前三的行业分别为：有色金属、煤炭、石油石化。

北上资金净流入75.49亿元，周内合计净流出29.75亿元。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，周内北上资金净卖出25.79亿元，其中买入315.17亿元，卖出340.96亿元；上证50指数50只成分股中有14只股票有北上资金参与，周内净卖出19.64亿元，其中买入147.71亿元，卖出167.35亿元；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2.57亿元，其中买入0.96亿元，卖出3.53亿元；中证1000指数1000只成分股中无股票参与。

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

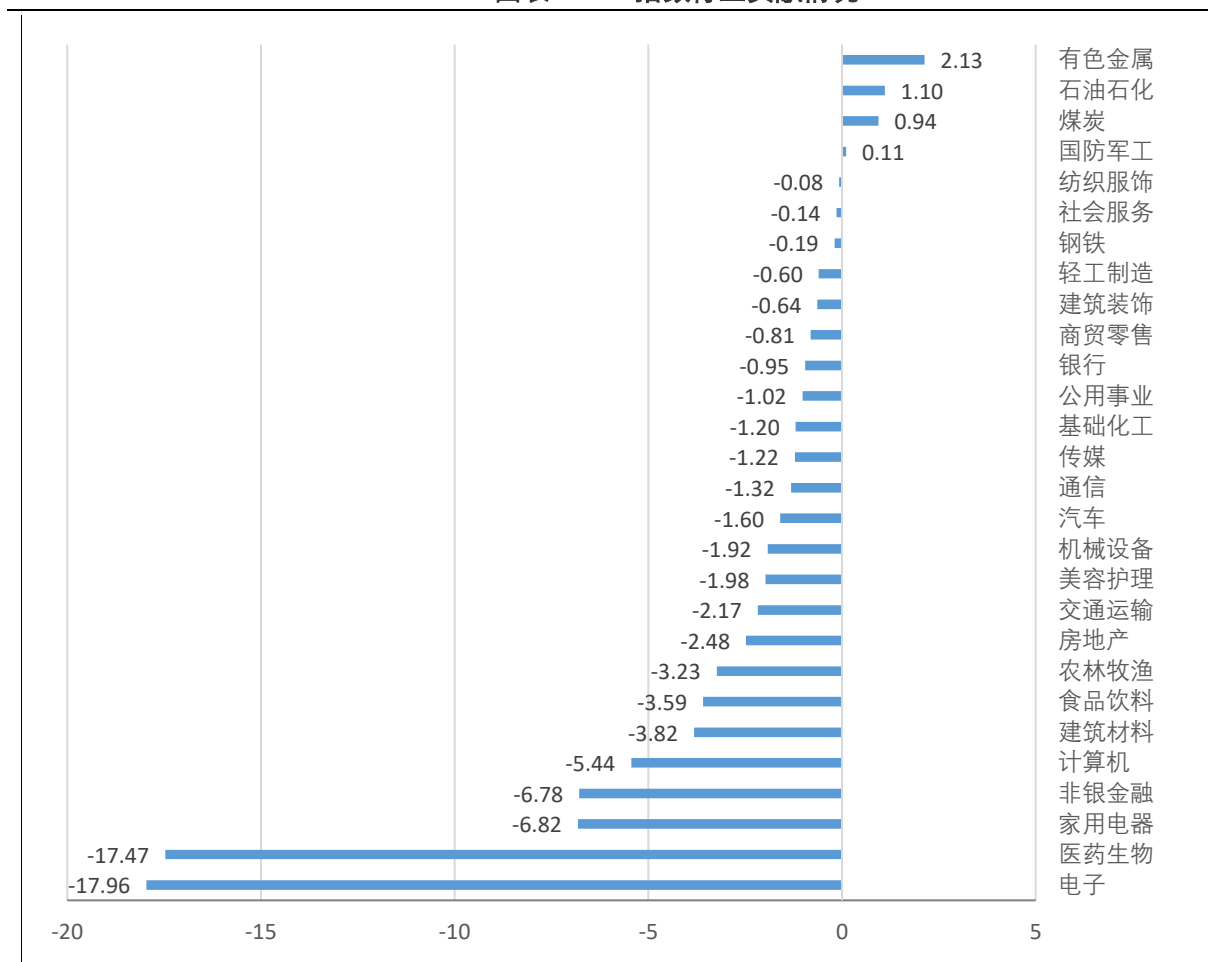
图表目录

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.....	错误!未定义书签。

1. 成分股指数拉动情况

2022年9月19日至9月23日，沪深300指数下跌72.4点。在沪深300指数的300只成分股中，有217只股票对指数下跌提供负贡献，有80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：电子、医药生物、家用电器；对IF指数周度跌幅提供正贡献排名前三的行业分别为：电力设备、有色金属、石油石化。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：迈瑞医疗、美的集团、东方财富、贵州茅台、片仔癀；对指数周度跌幅提供贡献点分别为：-3.97点，-3.68点，-3.59点，-3.14点，-2.45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、亿纬锂能、天齐锂业、中国石化、百润股份；对指数周度跌幅提供贡献点分别为：2.53点，2.01点，1.75点，0.87点，0.83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

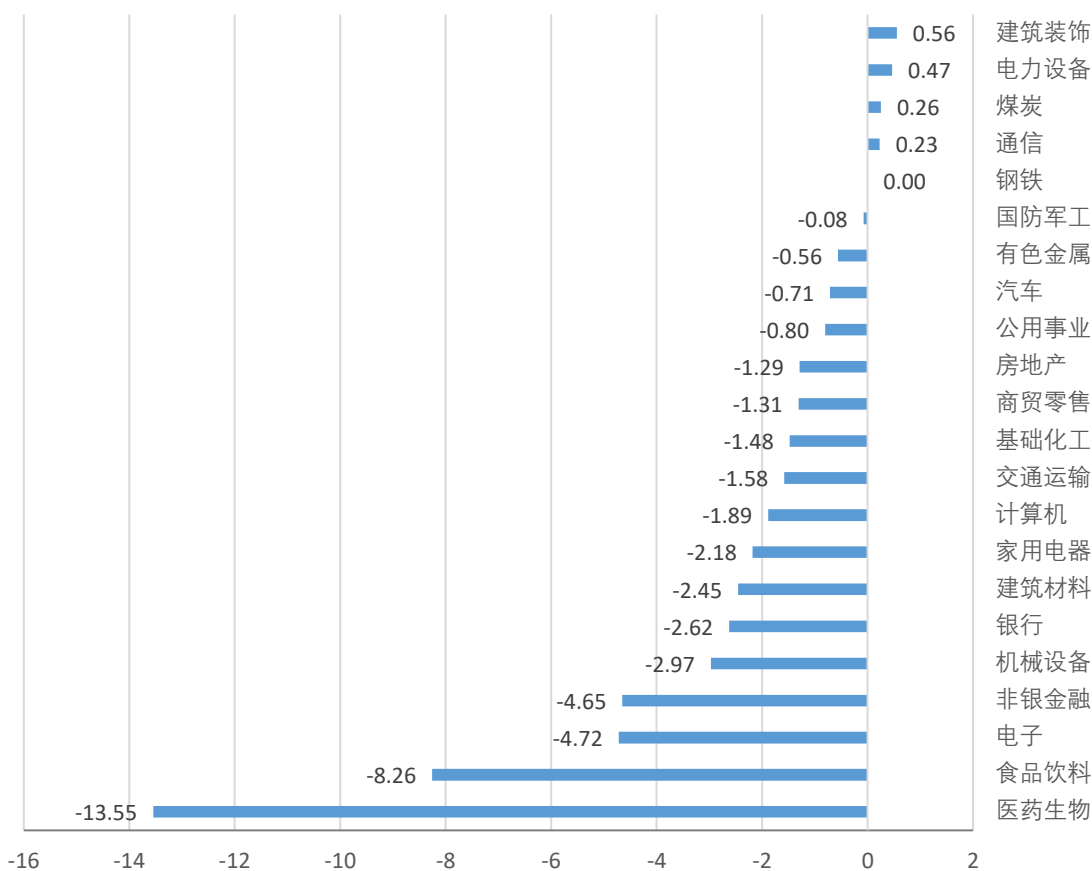
图表 2: IF 指数正/负贡献最大公司

	负贡献		正贡献	
	公司简称	点数	公司简称	点数
1	迈瑞医疗	-3.97	宁德时代	2.53
2	美的集团	-3.68	亿纬锂能	2.01
3	东方财富	-3.59	天齐锂业	1.75
4	贵州茅台	-3.14	中国石化	0.87
5	片仔癀	-2.45	百润股份	0.83
6	立讯精密	-2.25	宝丰能源	0.80
7	药明康德	-2.23	卫星化学	0.73
8	歌尔股份	-1.99	阳光电源	0.67
9	中国平安	-1.88	天赐材料	0.64
10	恒瑞医药	-1.71	晶澳科技	0.58

数据来源: wind, 兴证期货研发部

2022年9月19日至9月23日, 上证50指数下跌47.52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13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: 医药生物、食品饮料、电子; 对IH指数周度跌幅提供正贡献排名前三的行业分别为: 石油石化、建筑装饰、电力设备。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: 贵州茅台、片仔癀、药明康德、中国平安、恒瑞医药; 对指数周度跌幅提供贡献点分别为: -6.11点, -4.78点, -4.35点, -3.67点, -3.33点。对IH指数周度跌幅提供正贡献排名前五的股票分别为: 中国石化、中国石油、隆基绿能、中国建筑、工商银行; 对指数周度跌幅提供贡献点分别为: 1.7点, 1.03点, 0.72点, 0.56点, 0.55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

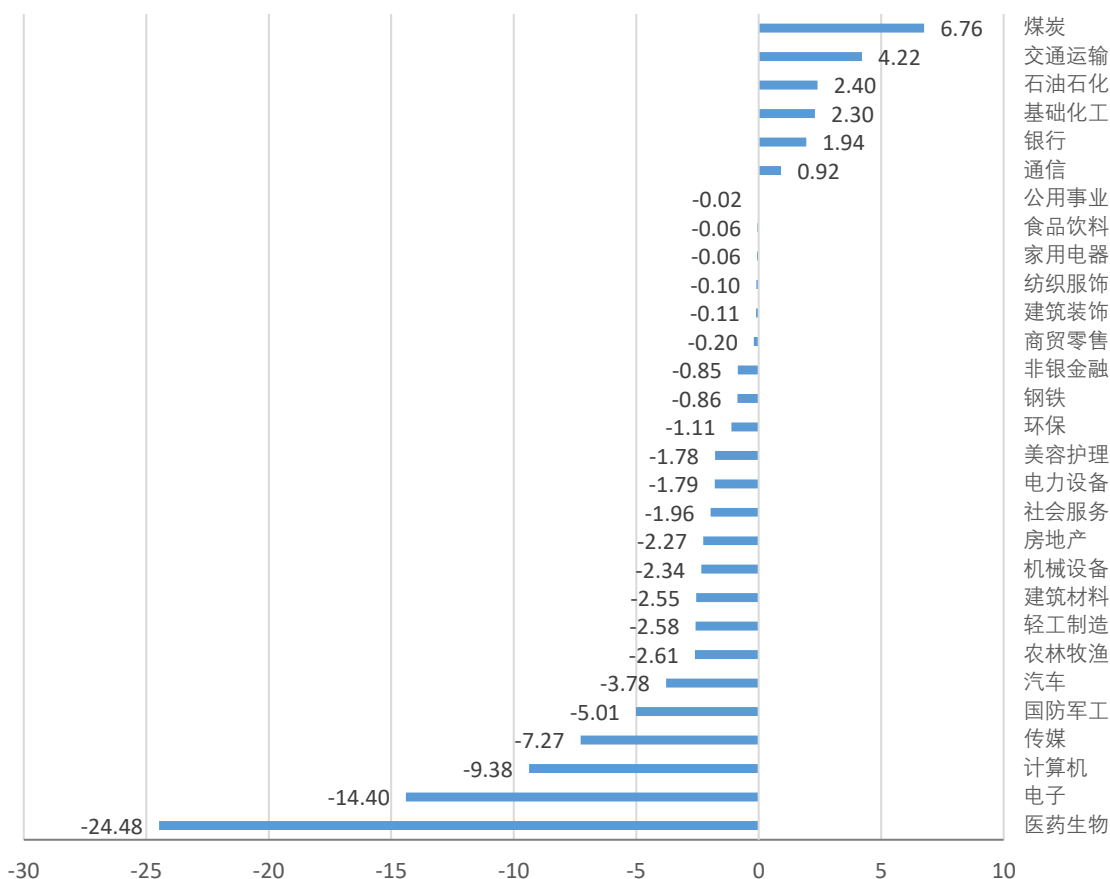
图表 4: IH 指数正/负贡献最大公司

	负贡献		正贡献	
	公司简称	点数	公司简称	点数
1	贵州茅台	-6.11	中国石化	1.70
2	片仔癀	-4.78	中国石油	1.03
3	药明康德	-4.35	隆基绿能	0.72
4	中国平安	-3.67	中国建筑	0.56
5	恒瑞医药	-3.33	工商银行	0.55
6	三一重工	-2.97	山西汾酒	0.43
7	招商银行	-2.84	农业银行	0.37
8	海螺水泥	-2.45	华友钴业	0.37
9	兆易创新	-2.30	海通证券	0.27
10	海尔智家	-2.18	中国神华	0.26

数据来源: wind, 兴证期货研发部

2022年9月19日至9月23日，中证500指数下跌58.25点。在中证500指数的500只成分股中，有342只股票对指数下跌提供负贡献，有144只股票提供正贡献，有14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：医药生物、电子、计算机；对IC指数周度跌幅提供正贡献排名前三的行业分别为：有色金属、煤炭、交通运输。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：纳思达、景嘉微、吉比特、卫士通、完美世界；对指数周度跌幅提供贡献点分别为：-2.32点，-1.87点，-1.84点，-1.32点，-1.32点。对IC指数周度跌幅提供正贡献排名前五的股票分别为：中远海能、云天化、多氟多、华阳股份、新宙邦；对指数周度跌幅提供贡献点分别为：2.51点，2.32点，2.25点，2.1点，1.98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

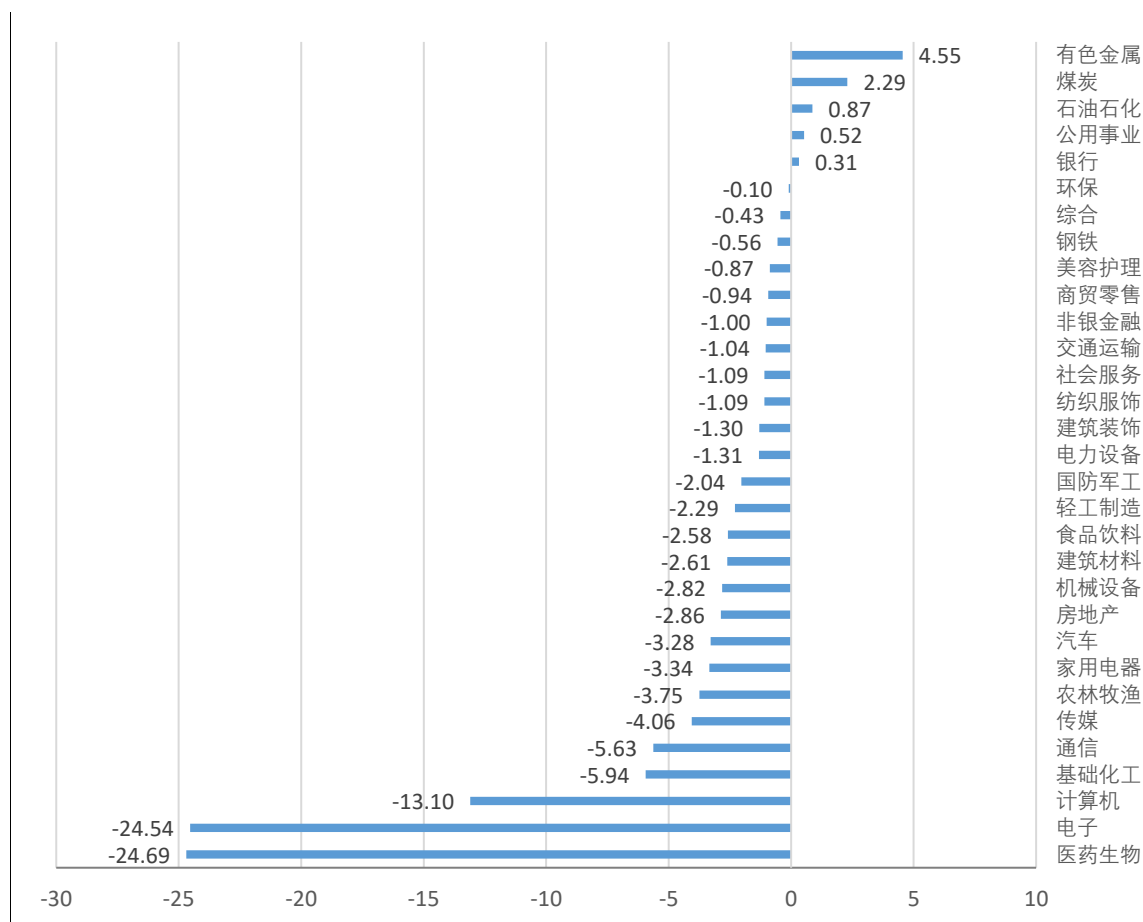
图表 6: IC 指数正/负贡献最大公司

	负贡献		正贡献	
	公司简称	点数	公司简称	点数
1	纳思达	-2.32	中远海能	2.51
2	景嘉微	-1.87	云天化	2.32
3	吉比特	-1.84	多氟多	2.25
4	卫士通	-1.32	华阳股份	2.10
5	完美世界	-1.32	新宙邦	1.98
6	宏发股份	-1.30	广汇能源	1.88
7	晶晨股份	-1.29	永兴材料	1.67
8	我武生物	-1.29	招商轮船	1.66
9	博腾股份	-1.17	山西焦煤	1.57
10	华海药业	-1.14	横店东磁	1.47

数据来源: wind, 兴证期货研发部

2022年9月19日至9月23日, 中证1000指数下跌104.71点。在中证1000指数的1000只成分股中, 有737只股票对指数下跌提供负贡献, 有243只股票提供正贡献, 有20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: 医药生物、电子、计算机; 对IC指数周度跌幅提供正贡献排名前三的行业分别为: 有色金属、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: 万业企业、极米科技、长川科技、移远通信、东方电缆; 对指数周度跌幅提供贡献点分别为: -1.98点, -1.74点, -1.54点, -1.37点, -1.36点。对IC指数周度跌幅提供正贡献排名前五的股票分别为: 派能科技、中矿资源、梅花生物、科华数据、双环传动; 对指数周度跌幅提供贡献点分别为: 2.21点, 1.73点, 1.63点, 1.51点, 1.46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	万业企业	-1.98	派能科技	2.21
2	极米科技	-1.74	中矿资源	1.73
3	长川科技	-1.54	梅花生物	1.63
4	移远通信	-1.37	科华数据	1.51
5	东方电缆	-1.36	双环传动	1.46
6	明泰铝业	-1.25	科士达	1.43
7	西藏矿业	-1.23	鹏辉能源	1.32
8	奕瑞科技	-1.20	川能动力	1.29
9	泰坦科技	-1.14	埃斯顿	1.17
10	爱博医疗	-1.13	盛路通信	1.12

数据来源: wind, 兴证期货研发部

2. 北上资金个股流向

2022年9月19日至9月23日，北上资金净流入75.49亿元，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2636.39亿元。在每日前十大活跃股中，沪深300指数300只成分股中有168只股票有北上资金参与，周内北上资金净买入2922.73亿元，其中买入66101.31亿元，卖出63178.58亿元；上证50指数50只成分股中有45只股票有北上资金参与，周内净买入1060.72亿元，其中买入33311.49亿元，卖出32250.77亿元；中证500指数500只成分股中有45只股票有北上资金参与，周内净卖出2.02亿元，其中买入476.86亿元，卖出478.88亿元；中证1000指数1000只成分股中有12只股票有北上资金参与，周内净买入13.74亿元，其中买入73.62亿元，卖出59.88亿元。

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
002466.SZ	天齐锂业	0.61	1.75	25.37	16.67	8.70
000333.SZ	美的集团	1.38	-3.68	9.08	3.64	5.44
002475.SZ	立讯精密	0.86	-2.25	17.83	12.95	4.87
600309.SH	万华化学	0.67	-0.76	5.09	2.06	3.03
600887.SH	伊利股份	0.94	-0.48	10.42	7.42	3.00
002460.SZ	赣锋锂业	0.51	0.57	8.83	6.14	2.70
000625.SZ	长安汽车	0.47	0.15	6.40	4.35	2.04
600745.SH	闻泰科技	0.26	-0.94	2.42	0.92	1.50
600809.SH	山西汾酒	0.69	0.22	5.05	4.23	0.82
600048.SH	保利发展	0.61	-0.66	9.86	9.42	0.44
601012.SH	隆基绿能	1.91	0.37	17.17	16.89	0.28
002050.SZ	三花智控	0.30	-0.11	2.38	2.64	-0.26
600900.SH	长江电力	1.39	-0.30	8.14	8.51	-0.38
002594.SZ	比亚迪	1.49	0.09	16.85	17.30	-0.45
601318.SH	中国平安	2.34	-1.88	11.84	12.60	-0.76
603501.SH	韦尔股份	0.38	-0.30	7.25	8.42	-1.18
000651.SZ	格力电器	0.81	-1.37	2.70	4.28	-1.58
002352.SZ	顺丰控股	0.50	-0.80	5.06	6.75	-1.69
600438.SH	通威股份	0.75	-0.13	14.24	16.09	-1.85
300760.SZ	迈瑞医疗	0.72	-3.97	9.82	12.44	-2.62
603259.SH	药明康德	0.98	-2.23	10.68	14.08	-3.39
300014.SZ	亿纬锂能	0.55	2.01	7.98	11.38	-3.40
600036.SH	招商银行	2.22	-1.46	9.09	13.33	-4.24
601888.SH	中国中免	1.05	-0.67	5.91	10.42	-4.51
300750.SZ	宁德时代	3.65	2.53	25.21	30.74	-5.53
300059.SZ	东方财富	1.21	-3.59	16.26	22.78	-6.52
300274.SZ	阳光电源	0.66	0.67	13.69	21.54	-7.85
600519.SH	贵州茅台	6.11	-3.14	30.56	42.95	-12.40

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
600309.SH	万华化学	1.89	-1.48	5.09	2.06	3.03
600887.SH	伊利股份	2.63	-0.93	10.42	7.42	3.00
600745.SH	闻泰科技	0.74	-1.83	2.42	0.92	1.50
600809.SH	山西汾酒	1.92	0.43	5.05	4.23	0.82
600048.SH	保利发展	1.72	-1.29	9.86	9.42	0.44
601012.SH	隆基绿能	5.35	0.72	17.17	16.89	0.28
600900.SH	长江电力	3.90	-0.58	8.14	8.51	-0.38
601318.SH	中国平安	6.55	-3.67	11.84	12.60	-0.76
603501.SH	韦尔股份	1.07	-0.59	7.25	8.42	-1.18
600438.SH	通威股份	2.09	-0.25	14.24	16.09	-1.85
603259.SH	药明康德	2.75	-4.35	10.68	14.08	-3.39
600036.SH	招商银行	6.23	-2.84	9.09	13.33	-4.24
601888.SH	中国中免	2.94	-1.31	5.91	10.42	-4.51
600519.SH	贵州茅台	17.12	-6.11	30.56	42.95	-12.40

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
601872.SH	招商轮船	0.35	1.66	0.96	3.53	-2.57

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。