

成分股监测报告

2022年8月10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1日至8月5日，沪深300指数下跌3.74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、银行、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：计算机、有色金属、通信。上证50指数下跌11.36点。对IH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、非银金融、银行；对IH指数周度跌幅提供正贡献排名前三的行业分别为：计算机、有色金属、国防军工。中证500指数下跌22.87点。对IC指数周度跌幅提供负贡献排名前三的行业分别为：钢铁、交通运输、公用事业；对IC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、医药生物、通信。中证1000指数下跌10.71点。对IC指数周度跌幅提供负贡献排名前三的行业分别为：汽车、电力设备、公用事业；对IM指数周度跌幅提供正贡献排名前三的行业分别为：房地产、食品饮料、社会服务。

北上资金净流出12.33亿元，周内合计净流出19.16亿元。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26.3亿元，其中买入406.17亿元，卖出432.47亿元；上证50指数50只成分股中有14只股票有北上资金参与，周内净买入2.69亿元，其中买入185.24亿元，卖出182.55亿元；中证500指数500只成分股中有2只股票有北上资金参与，周内净买入1.78亿元，其中买入7.66亿元，卖出5.89亿元。

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

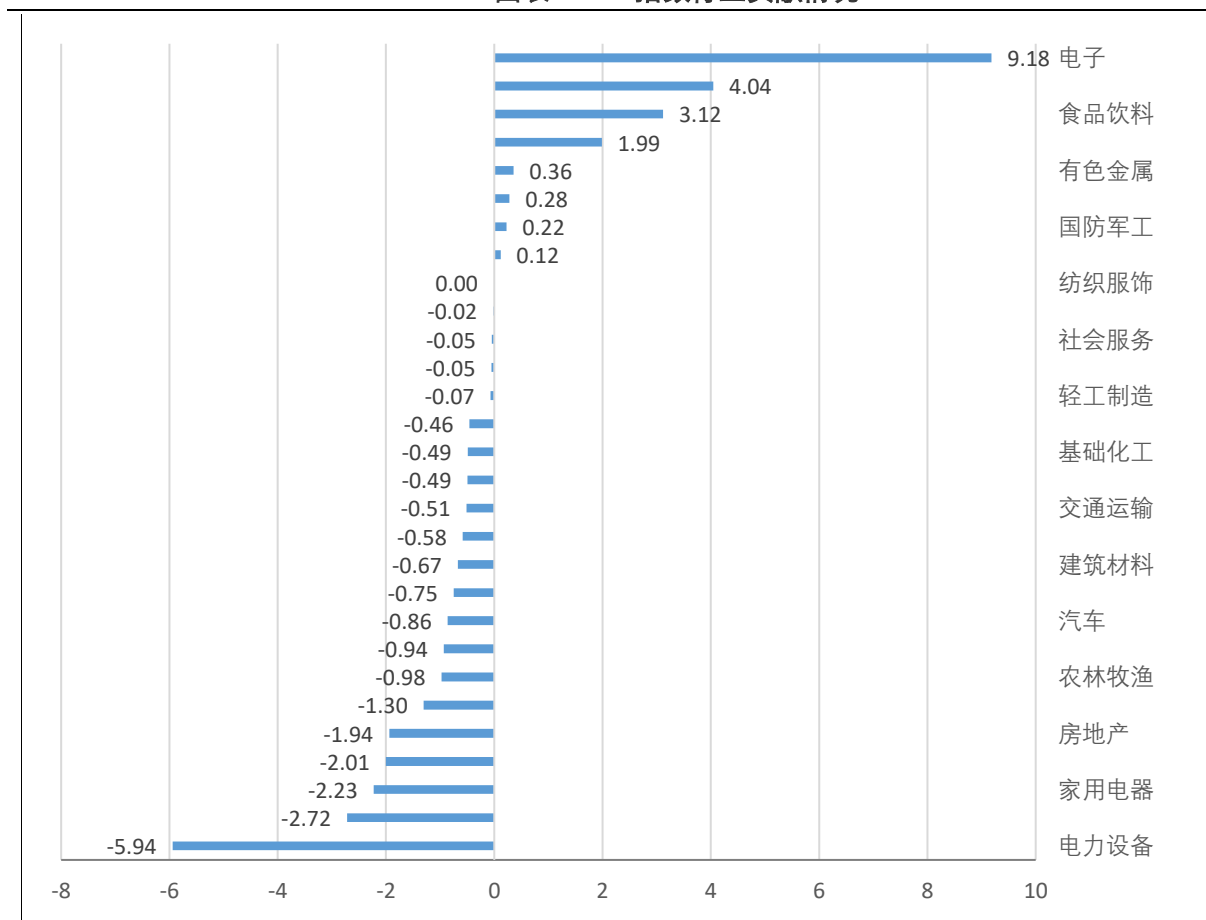
图表目录

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 8: IH 北上资金流入情况.....	11
图表 9: IC 北上资金流入情况.....	11

1. 成分股指数拉动情况

2022年8月1日至8月5日，沪深300指数下跌3.74点。在沪深300指数的300只成分股中，有176只股票对指数下跌提供负贡献，有122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：电力设备、银行、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：计算机、有色金属、通信。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：隆基绿能、中国中免、美的集团、招商银行、保利发展；对指数周度跌幅提供贡献点分别为：-2.44点，-0.91点，-0.83点，-0.8点，-0.79点。对IF指数周度跌幅提供正贡献排名前五的股票分别为：北方华创、贵州茅台、长春高新、恒瑞医药、中微公司；对指数周度跌幅提供贡献点分别为：1.42点，1.35点，1.06点，1.03点，0.82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

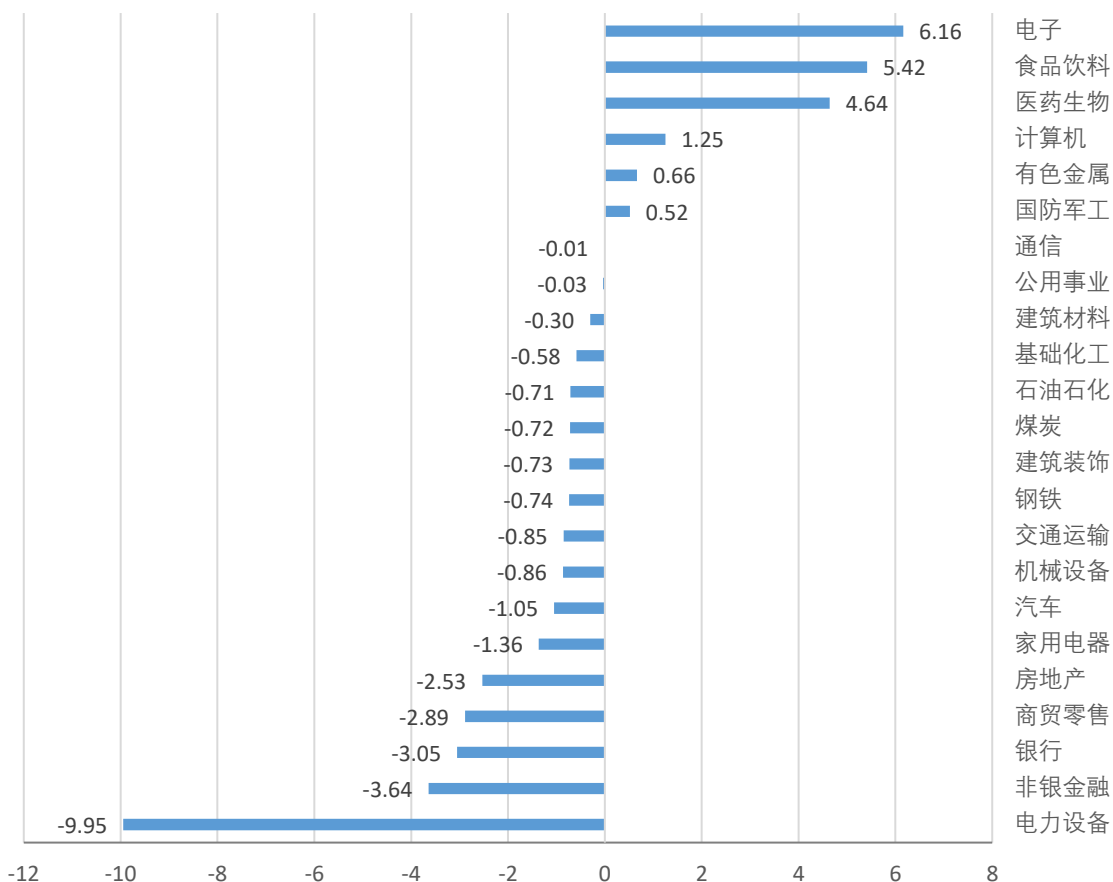
图表 2: IH 指数正/负贡献最大公司

	负贡献		正贡献	
	公司简称	点数	公司简称	点数
1	隆基绿能	-2.44	北方华创	1.42
2	中国中免	-0.91	贵州茅台	1.35
3	美的集团	-0.83	长春高新	1.06
4	招商银行	-0.80	恒瑞医药	1.03
5	保利发展	-0.79	中微公司	0.82
6	阳光电源	-0.74	韦尔股份	0.70
7	三花智控	-0.73	中芯国际	0.69
8	通威股份	-0.68	兆易创新	0.67
9	宁波银行	-0.55	闻泰科技	0.57
10	中国平安	-0.53	古井贡酒	0.55

数据来源: wind, 兴证期货研发部

2022年8月1日至8月5日, 上证50指数下跌11.36点。在上证50指数的50只成分股中, 有31只股票对指数下跌提供负贡献, 有19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: 电力设备、非银金融、银行; 对IH指数周度跌幅提供正贡献排名前三的行业分别为: 计算机、有色金属、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: 隆基绿能、中国中免、招商银行、保利发展、通威股份; 对指数周度跌幅提供贡献点分别为: -7.78点, -2.89点, -2.56点, -2.53点, -2.17点。对IH指数周度跌幅提供正贡献排名前五的股票分别为: 贵州茅台、恒瑞医药、韦尔股份、兆易创新、闻泰科技; 对指数周度跌幅提供贡献点分别为: 4.31点, 3.29点, 2.22点, 2.12点, 1.82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

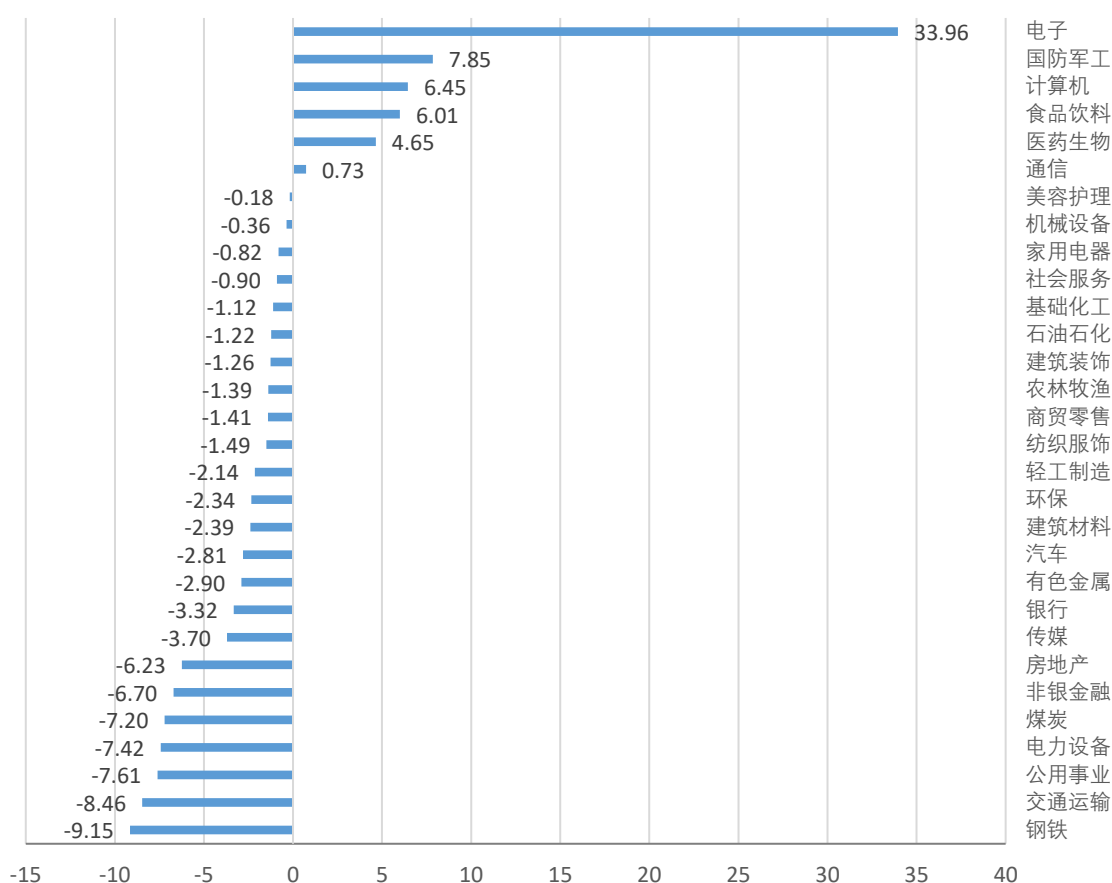
图表 4: IH 指数正/负贡献最大公司

	负贡献		正贡献	
	公司简称	点数	公司简称	点数
1	隆基绿能	-7.78	贵州茅台	4.31
2	中国中免	-2.89	恒瑞医药	3.29
3	招商银行	-2.56	韦尔股份	2.22
4	保利发展	-2.53	兆易创新	2.12
5	通威股份	-2.17	闻泰科技	1.82
6	中国平安	-1.69	药明康德	1.29
7	海尔智家	-1.36	北方稀土	0.94
8	长城汽车	-0.91	伊利股份	0.73
9	三一重工	-0.86	恒生电子	0.63
10	中远海控	-0.85	用友网络	0.62

数据来源: wind, 兴证期货研发部

2022年8月1日至8月5日，中证500指数下跌22.87点。在中证500指数的500只成分股中，有332只股票对指数下跌提供负贡献，有163只股票提供正贡献，有5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：钢铁、交通运输、公用事业；对IC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、医药生物、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：攀钢钒钛、横店东磁、中科三环、爱旭股份、北摩高科；对指数周度跌幅提供贡献点分别为：-4.32点，-2.79点，-2.65点，-2.59点，-2.38点。对IC指数周度跌幅提供正贡献排名前五的股票分别为：晶晨股份、雅克科技、德方纳米、芯原股份、景嘉微；对指数周度跌幅提供贡献点分别为：4.34点，4.08点，3.84点，3.7点，3.31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

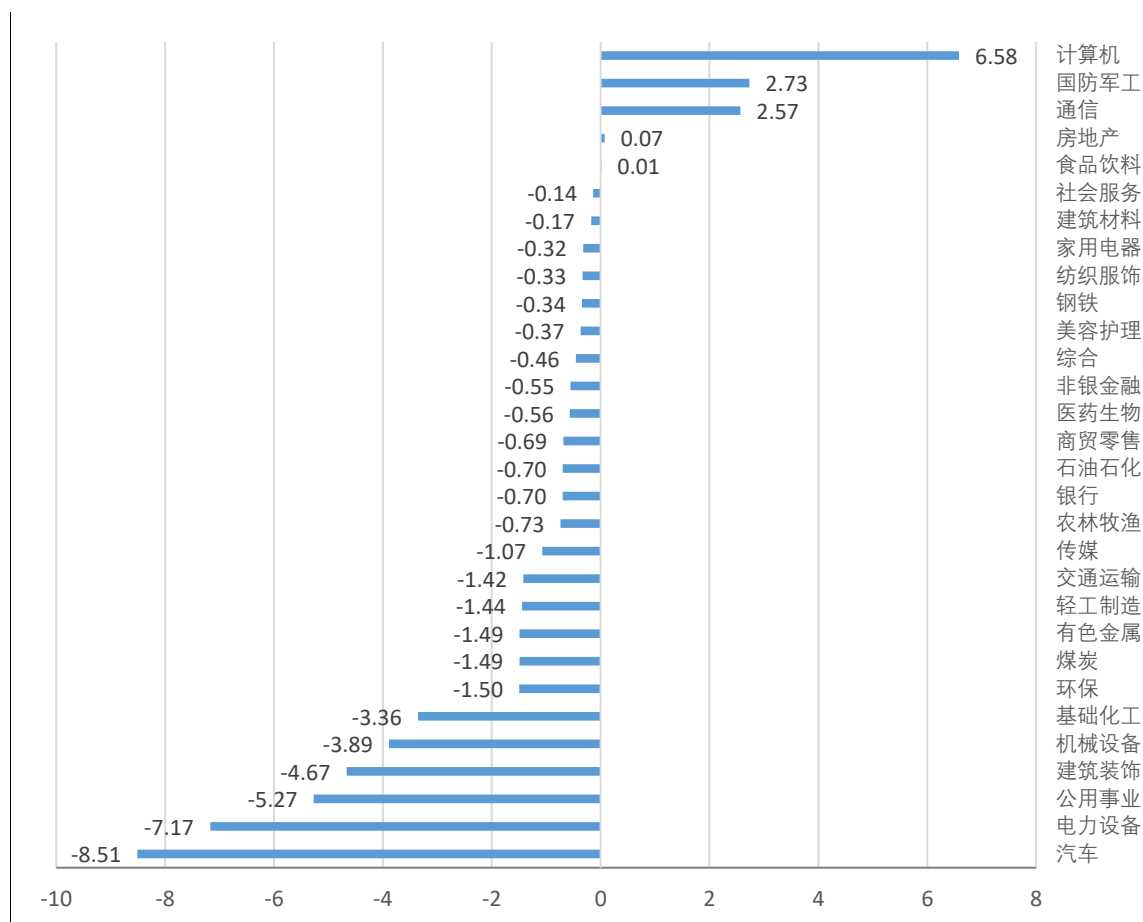
图表 6: IC 指数正/负贡献最大公司

	负贡献		正贡献	
	公司简称	点数	公司简称	点数
1	攀钢钒钛	-4.32	晶晨股份	4.34
2	横店东磁	-2.79	雅克科技	4.08
3	中科三环	-2.65	德方纳米	3.84
4	爱旭股份	-2.59	芯原股份	3.70
5	北摩高科	-2.38	景嘉微	3.31
6	明阳智能	-2.04	华天科技	3.29
7	均胜电子	-1.77	人福医药	2.72
8	中鼎股份	-1.71	航天发展	2.55
9	华阳股份	-1.65	睿创微纳	2.54
10	协鑫集成	-1.64	中国软件	2.36

数据来源: wind, 兴证期货研发部

2022年8月1日至8月5日, 中证1000指数下跌10.71点。在中证1000指数的1000只成分股中, 有613只股票对指数下跌提供负贡献, 有383只股票提供正贡献, 有4只股票贡献为0。分行业看, 对IC指数周度跌幅提供负贡献排名前三的行业分别为: 钢铁、交通运输、公用事业; 对IC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、医药生物、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: 双环传动、东方日升、鼎胜新材、双星新材、东方电缆; 对指数周度跌幅提供贡献点分别为: -1.14点, -0.97点, -0.83点, -0.82点, -0.82点。对IC指数周度跌幅提供正贡献排名前五的股票分别为: 南都电源、华峰测控、芯源微、万业企业、和而泰; 对指数周度跌幅提供贡献点分别为: 1.93点, 1.52点, 1.34点, 1.26点, 1.25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	双环传动	-1.14	南都电源	1.93
2	东方日升	-0.97	华峰测控	1.52
3	鼎胜新材	-0.83	芯源微	1.34
4	双星新材	-0.82	万业企业	1.26
5	东方电缆	-0.82	和而泰	1.25
6	中信博	-0.79	南大光电	1.20
7	埃斯顿	-0.78	蓝晓科技	1.16
8	爱康科技	-0.78	兴森科技	1.05
9	伯特利	-0.75	鼎龙股份	0.97
10	太阳能	-0.69	江丰电子	0.89

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1日至8月5日，北上资金净流出12.33亿元，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19.16亿元。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26.3亿元，其中买入406.17亿元，卖出432.47亿元；上证50指数50只成分股中有14只股票有北上资金参与，周内净买入2.69亿元，其中买入185.24亿元，卖出182.55亿元；中证500指数500只成分股中有2只股票有北上资金参与，周内净买入1.78亿元，其中买入7.66亿元，卖出5.89亿元。

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
000333.SZ	美的集团	1.44	-0.13	11.68	3.59	8.08
600036.SH	招商银行	2.67	-1.75	21.15	13.80	7.35
603799.SH	华友钴业	0.52	-1.17	13.41	6.44	6.97
002475.SZ	立讯精密	0.88	3.52	13.52	7.13	6.39
601012.SH	隆基绿能	1.85	1.88	30.27	27.17	3.10
600276.SH	恒瑞医药	0.73	-3.11	6.51	3.71	2.80
002812.SZ	恩捷股份	0.64	-0.36	8.98	6.66	2.32
600809.SH	山西汾酒	0.72	-1.85	3.97	1.69	2.28
000858.SZ	五粮液	1.80	-3.26	15.59	13.32	2.27
002594.SZ	比亚迪	1.48	-1.84	21.79	19.89	1.90
000568.SZ	泸州老窖	0.85	-1.70	3.94	2.12	1.82
300760.SZ	迈瑞医疗	0.80	-1.64	3.63	1.82	1.81
300014.SZ	亿纬锂能	0.53	-0.98	2.99	1.30	1.69
300015.SZ	爱尔眼科	0.54	-2.04	4.03	2.44	1.59
603259.SH	药明康德	1.04	-4.16	12.18	11.43	0.74
002460.SZ	赣锋锂业	0.51	-1.01	3.39	2.75	0.64
600406.SH	国电南瑞	0.53	-0.46	5.22	5.20	0.02
600519.SH	贵州茅台	6.10	-6.83	36.17	37.01	-0.83
002466.SZ	天齐锂业	0.54	-0.28	21.04	22.33	-1.29
000625.SZ	长安汽车	0.30	0.58	4.74	6.04	-1.30
601318.SH	中国平安	2.60	-2.52	2.81	4.12	-1.31
601888.SH	中国中免	0.93	-0.92	16.42	17.74	-1.32
600196.SH	复星医药	0.28	-1.10	1.44	3.00	-1.57
002008.SZ	大族激光	0.14	0.39	2.75	4.46	-1.71
002371.SZ	北方华创	0.39	-1.27	1.40	3.48	-2.09
000001.SZ	平安银行	0.74	-0.34	0.82	3.29	-2.47
300750.SZ	宁德时代	3.23	-6.37	31.98	34.80	-2.82
600887.SH	伊利股份	1.02	-0.57	5.87	8.73	-2.85
600438.SH	通威股份	0.66	-1.22	18.27	24.19	-5.92
002714.SZ	牧原股份	0.72	0.44	3.77	9.97	-6.20
002050.SZ	三花智控	0.17	1.31	2.91	11.83	-8.92
300274.SZ	阳光电源	0.46	1.73	14.24	23.54	-9.30

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
600036.SH	招商银行	7.12	-3.23	21.15	13.80	7.35
601012.SH	隆基绿能	4.97	3.49	30.27	27.17	3.10
600276.SH	恒瑞医药	1.97	-5.81	6.51	3.71	2.80
600809.SH	山西汾酒	1.93	-3.42	3.97	1.69	2.28
603259.SH	药明康德	2.83	-7.82	12.18	11.43	0.74
600519.SH	贵州茅台	16.42	-12.71	36.17	37.01	-0.83
601318.SH	中国平安	6.94	-4.65	2.81	4.12	-1.31
601888.SH	中国中免	2.50	-1.71	16.42	17.74	-1.32
600196.SH	复星医药	0.77	-2.06	1.44	3.00	-1.57
600887.SH	伊利股份	2.82	-1.09	5.87	8.73	-2.85
600438.SH	通威股份	1.77	-2.25	18.27	24.19	-5.92

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
600522.SH	中天科技	0.85	0.94	9.53	4.62	4.91
601615.SH	明阳智能	0.65	0.26	2.42	1.46	0.95
002340.SZ	格林美	0.61	-0.14	1.95	3.36	-1.41

数据来源: wind, 兴证期货研发部

图表 9: 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
002738.SZ	中矿资源	0.51	0.02	3.78	1.55	2.22
603606.SH	东方电缆	0.48	-0.05	2.87	1.28	1.59

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。