

市场月度统计分析(2007年8月)

八月重现沪强深弱格局

上海申银万国证券研究所 马骏 杨国平

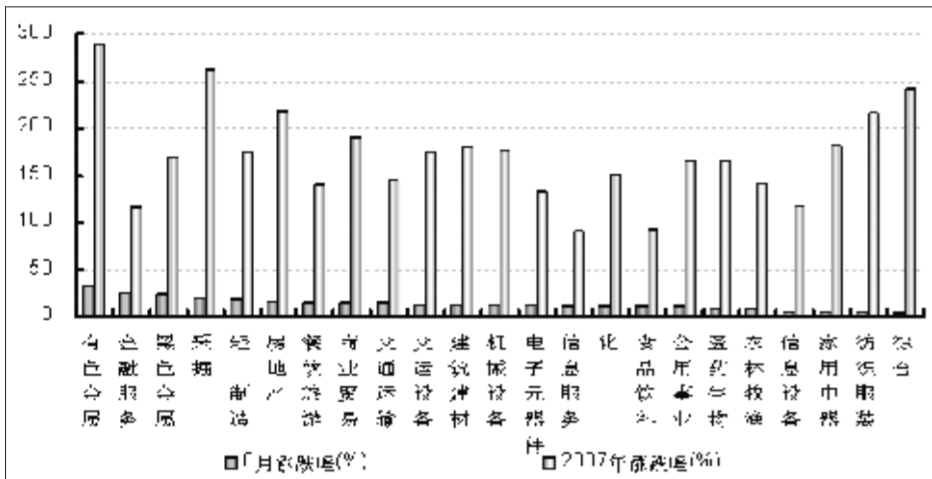
沪深市场运行概况

Table with columns: 项目, 2007年8月31日 (上海, 深圳, 两市), 与2007年7月31日相比 (上海, 深圳, 两市). Rows include 上证指数/深证综指, 上证180/深证100, etc.

2007年8月,上证指数在突破5000点大关后,维持上行强势并创出历史新高5235.16点,月度涨幅(16.7%)接近7月水平(17.0%);沪市一改前期颓势,重现沪强深弱格局,其中上证50(22.4%)涨幅最大,涨幅最小的中小板指8月仅上涨9.25%;受到半年报业绩推动,绩优蓝筹股领衔的各大成份指数(上证50、深成指、中万50)均优于大盘指数。

伴随上涨行情我们欣喜地看到,在连续两个月成交大幅萎缩后,8月两市A股日均成交额达到2354亿元,较7月增长59.1%;目前,沪市A股总股本加权均价、算术均价分别为15.5元、19.6元,根据上市公司2007年半年报业绩计算的A股整体市盈率为40倍,市净率6.4倍,超过70%的业绩增长率为本轮上涨行情的坚强后盾。

申万行业指数月度及2007年表现



8月23个申万一级行业指数中,有色金属(32.7%)、金融服务(24.6%)、黑色金属(24.3%)涨幅均在24%以上,其中有色金属业的2007年涨幅已高达290%,其月度成交占比环比增幅(18.9%)也最大;涨幅较小的是综合、纺织服装、家用电器行业,同时,综合、纺织服装的成交占比环比分别下降31.4%和24.1%。

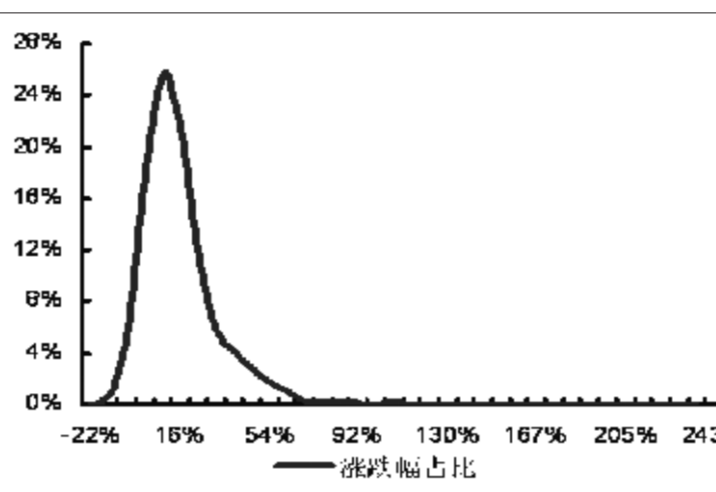
权重股表现 苏宁电器跻身沪深300前十权重股

Table of top 10 weighted stocks in Shanghai and Shenzhen markets. Columns: 股票代码, 股票简称, 权重(%), 涨跌幅(%). Includes 工商银行, 中国人寿, 中国石化, etc.

Table of top 10 weighted stocks in Shanghai and Shenzhen markets. Columns: 股票代码, 股票简称, 权重(%), 涨跌幅(%). Includes 万科A, 鞍钢股份, 五粮液, etc.

沪市前十权重股中,中国铝业涨幅(101%)最大,其次宝钢股份、招商银行、中国平安涨幅均超20%;深市方面,鞍钢股份、云南铜业、苏宁电器、华侨城A各行业龙头公司涨势喜人,涨幅都在25%以上。沪深300最新的前十权重股中,经过本轮上涨,中信证券月末权重接近5%,跃升首席;家电连锁企业苏宁电器首次进入前十名,我们股票研究部给予了“买入”评级,值得关注。

8月个股涨跌分布图



行业贡献度分析 金融、有色驱动大盘

Table of industry contribution analysis. Columns: 行业, 贡献度(%), 涨跌幅(%), 换手率(%), 市盈率(倍). Rows include 金融服务, 有色金属, 房地产, etc.

8月对沪深两市流通市值变动贡献最大的前5个一级行业依次是金融服务、有色金属、房地产、黑色金属和交通运输,这5个行业贡献了整个市值变动额的58.7%,其中涨幅最大的是有色金属(32.7%),其月度换手率也高达120%;我们的8月资金报告(详见撰文《2007年8月股票市场资金分析》)显示,银行、房地产开发、有色金属冶炼、钢铁、证券板块的资金流入明显。

个股贡献度分析 保险股逆市而上

Table of individual stock contribution analysis. Columns: 股票简称, 正向贡献度%, 涨跌幅%, 股票简称, 反向贡献度%, 涨跌幅%. Rows include 工商银行, 中国铝业, 中国人寿, etc.

8月上海A股市场上证指数上涨贡献最大的前10个个股贡献度总和为51.2%;其中工商银行(10.7%)、中国铝业(9.08%)、中国人寿(6.53%)合计正向贡献度超过25%,中国铝业在重组消息明期的重大利好刺激下大幅上涨101.6%;反向贡献最大的十只个股中,前期广受关注的杭萧钢构(-19.1%)跌幅最大。

Table of top 10 contributing and detracting stocks in the Shenzhen market. Columns: 股票简称, 正向贡献度%, 涨跌幅%, 股票简称, 反向贡献度%, 涨跌幅%. Rows include 万科A, 鞍钢股份, 云南铜业, etc.

深圳A股正向贡献前十名个股共占26.9%,8月上涨48%的万科A的贡献度(7.15%)最大,另外,本钢板材(52.7%)、泛海建设(52.2%)涨幅均在50%以上;8月反向贡献度前十名中,跌幅最大的是上市首日被暴炒近期逐步回归价值的拓邦电子(-30.1%)。

上海证券报系列指数

Table of Shanghai Securities Journal series indices. Columns: 指数名称, 收盘, 涨跌, 涨跌幅(%), 成交额(亿元). Rows include 上海证券报指数, 上证报中国百强指数, etc.

三大指数表现

Table of performance of three major indices. Columns: 项目, 中证流通指数, 中证100指数, 沪深300指数. Rows include 前收盘, 开盘, 最高, 最低, etc.

按行业、概念分资金流向一览

Table of fund flow by industry and concept. Columns: 行业分类, 成交金额(亿元), 较前增减(%), 概念分类, 成交金额(亿元), 较前增减(%). Rows include 钢铁, 化肥, 化工机械, etc.

涨幅前十

Table of top 10 gainers. Columns: 沪市, 深市. Rows include 广钢股份, 世纪光华, 徐工科技, etc.

换手前十

Table of top 10 turnover. Columns: 沪市, 深市. Rows include 厦工股份, ST丹化, 中技贸易, etc.

跌幅前十

Table of top 10 losers. Columns: 沪市, 深市. Rows include 风神股份, \*ST方兴, \*ST鑫安, etc.

AB股比价

AB股比价较大个股一览

Table of AB share price ratio for large individual stocks. Columns: 代码, 名称, AB股价格比, B股价格(HKD/USD), B股价格(CNY), A股代码, A股简称, A股价格(CNY). Rows include \*ST宝石B, 深特力B, etc.

注:资金流向一览、连续涨跌一览、成交大增一览由港澳资讯金融工程事业部制作;送离成本一览、主动增仓一览、先头阳线光脚阴线一览由讯息制作。

数据掘金

部分连续上涨个股一览

Table of individual stocks with continuous price increases. Columns: 股票代码, 股票名称, 收盘价(元), 连涨天数, 连涨幅度(%), 累计换手率(%). Rows include 公用科技, \*ST锦股, etc.

部分光头阳线、光脚阴线个股一览

Table of individual stocks with specific candlestick patterns. Columns: 股票代码, 股票名称, 开盘价(元), 收盘价(元), 涨幅(%), 振幅(%). Rows include 闽东电力, 芜湖港, etc.

部分连续下跌个股一览

Table of individual stocks with continuous price decreases. Columns: 股票代码, 股票名称, 收盘价(元), 连跌天数, 连跌幅度(%), 累计换手率(%). Rows include \*ST金泰, 新希望, etc.

部分远离当日成本个股一览

Table of individual stocks far from their daily cost. Columns: 股票代码, 股票名称, 远度(%), 均价(元), 收盘价(元), 涨跌幅(%). Rows include 中技贸易, 高新发展, etc.

部分成交量突增个股一览

Table of individual stocks with significant volume increases. Columns: 股票代码, 股票名称, 5日涨跌幅(%), 5日均量(手), 20日均量(手), 突增量(%). Rows include \*ST宝龙, 天宇电气, etc.

部分主动增仓个股一览

Table of individual stocks with active buying. Columns: 股票代码, 股票名称, 主动增仓量(万股), 内盘(万股), 外盘(万股), 涨跌幅(%). Rows include 工商银行, 中国银行, etc.