

中证指数月度报告(10月)

中证指数有限公司 上海证券报联合推出

主要指数月度表现

	开盘	最高	最低	收盘	涨跌点数	涨跌幅(%)	成交量(万手)	成交金额(亿元)
沪深300	5703.28	5891.72	5266.37	5688.54	107.73	1.93%	5180.15	1085.56
中证100	5838.03	6172.28	5600.02	6027.77	318.26	5.57%	3304.60	674.61
中证800	5543.81	5637.83	4973.92	5391.91	-38.73	-0.71%	8053.53	1493.30
中证200	5788.18	5799.58	4922.97	5377.58	-292.22	-5.15%	1875.55	410.94
中证500	5169.24	5178.60	4126.57	4550.18	-533.47	-10.49%	2873.38	407.74
中证700	5496.82	5506.82	4548.28	4988.22	-405.64	-7.52%	4748.93	818.68
上证指数	5683.31	6124.04	5462.01	5954.77	402.46	7.25%	7448.14	1339.02
上证180	12690.58	13325.04	11868.48	12800.64	384.63	3.10%	3891.96	752.80
上证50	4407.50	4772.93	4313.80	4627.78	320.36	7.44%	2588.44	473.70
上证红利	4970.67	5272.32	4483.46	4929.97	50.16	1.03%	957.41	182.57
深证成指	19287.61	19600.03	17933.30	19531.15	666.61	3.53%	587.78	189.94

最近三个月来,上证50与中证100指数涨幅居前,分别上涨36.44%与33.91%,小盘指数中证500表现最差,仅涨3.33%。年初至今,表现最好的指数为中证200,涨幅为202.71%,表现最差的指数为上证指数,涨幅为122.57%,沪深300涨幅为178.71%,远远超过上证指数。

阶段收益情况

	最近1个月	最近3个月	最近半年	最近1年	年初至今
沪深300	1.93%	27.53%	59.85%	288.44%	178.71%
中证100	5.57%	33.91%	71.45%	294.70%	165.48%
中证800	-0.71%	21.98%	48.93%	265.07%	176.66%
中证200	-5.15%	15.82%	40.00%	273.93%	202.71%
中证500	-10.49%	3.33%	16.56%	195.15%	163.60%
中证700	-7.52%	10.10%	28.79%	234.92%	184.45%
上证指数	7.25%	33.19%	55.02%	223.98%	122.57%
上证180	3.10%	29.80%	60.06%	280.35%	167.78%
上证50	7.44%	36.44%	67.81%	287.64%	156.34%
上证红利	1.03%	29.76%	51.42%	289.97%	175.61%

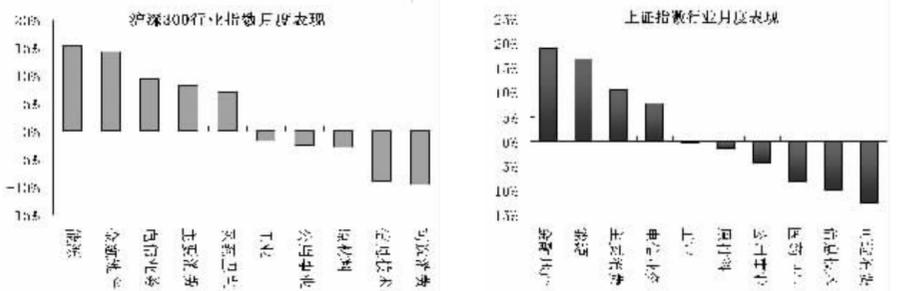
阶段波动情况

	1个月	最近3个月	最近半年	最近1年	年初至今
沪深300	30.21%	30.18%	36.45%	35.85%	37.01%
中证100	30.78%	30.83%	35.11%	35.63%	36.31%
中证800	30.50%	30.21%	37.82%	36.17%	37.80%
中证200	32.32%	31.79%	41.27%	38.96%	41.03%
中证500	38.01%	34.23%	45.05%	40.65%	43.36%
中证700	34.27%	32.49%	42.69%	39.38%	41.79%
上证指数	33.82%	29.49%	34.58%	33.57%	35.00%
上证180	31.39%	30.48%	35.85%	35.51%	36.63%
上证50	32.28%	31.27%	34.49%	35.50%	36.15%
上证红利	42.92%	37.56%	42.68%	41.68%	43.14%

行业指数表现

	沪深300	中证800	上证指数	上证180
能源	15.38%	14.01%	16.73%	18.34%
原材料	-2.98%	-3.96%	-1.49%	-0.90%
工业	-1.70%	-3.74%	-0.39%	-0.64%
可选消费	-9.64%	-10.74%	-12.55%	-12.57%
主要消费	8.09%	4.04%	10.48%	10.87%
医药卫生	6.91%	0.48%	-8.34%	-5.00%
金融地产	14.27%	12.77%	19.01%	12.42%
信息技术	-8.95%	-11.24%	-9.92%	-9.45%
电信业务	9.26%	5.59%	7.69%	11.16%
公用事业	-2.69%	-3.72%	-4.36%	-0.22%

10月,在油价不断攀高,中石油上市及成品油提价的刺激下,中国石化为主导的能源板块继续强势上涨,沪深300能源指数涨幅达到15.38%,在所有沪深300行业指数中涨幅第一。而金融地产类股在10月份也表现优异,沪深300金融地产指数涨幅达到14.27%。另外,在蓝筹股的带动下,电信业务、主要消费等行业指数也都分别上涨了9.28%与8.09%。而可选消费与信息技术表现较差,出现较大幅度的下跌。



行业对指数贡献度

	沪深300	中证800	上证指数	上证180
能源	31.44%	51.25%	28.37%	37.47%
原材料	-10.34%	-29.25%	-1.73%	-1.93%
工业	-4.88%	-23.34%	-0.58%	-1.48%
可选消费	-15.74%	-42.05%	-6.07%	-12.07%
主要消费	7.32%	7.98%	3.68%	5.74%
医药卫生	2.06%	0.49%	-1.16%	-0.75%
金融地产	93.15%	150.33%	79.46%	71.75%
信息技术	-3.06%	-10.56%	-1.05%	-1.99%
电信业务	3.27%	4.00%	1.00%	3.51%
公用事业	-3.23%	-8.85%	-1.93%	-0.25%

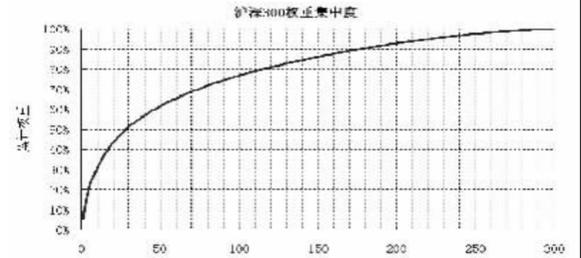
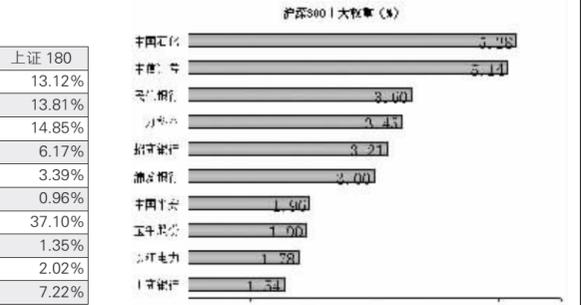
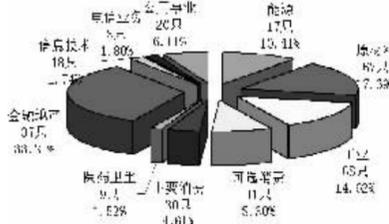
行业市场估值

	P/E	P/B	EPS	ROE	ROA
沪深300	39.68	5.71	0.51	14.38%	2.59%
能源	29.79	5.93	0.92	19.91%	14.35%
原材料	31.22	5.42	0.83	17.38%	10.02%
工业	42.56	6.36	0.49	14.94%	8.27%
可选消费	45.07	5.11	0.48	11.33%	6.23%
主要消费	70.5	12.25	0.59	17.38%	9.86%
医药卫生	39.32	7.24	0.69	18.40%	11.81%
金融地产	38.96	5.15	0.41	13.22%	1.39%
信息技术	48.31	5.02	0.33	10.39%	6.70%
电信业务	37.37	2.63	0.33	7.05%	6.72%
公用事业	31.8	3.66	0.5	11.51%	6.34%

行业权重占比

	沪深300	中证800	上证指数	上证180
能源	10.41%	9.14%	16.23%	13.12%
原材料	17.69%	18.45%	11.09%	13.81%
工业	14.62%	15.61%	13.96%	14.85%
可选消费	8.30%	9.78%	4.63%	6.17%
主要消费	4.61%	4.94%	3.36%	3.39%
医药卫生	1.52%	2.55%	1.34%	0.96%
金融地产	33.21%	29.43%	39.98%	37.10%
信息技术	1.74%	2.35%	1.01%	1.35%
电信业务	1.80%	1.79%	1.24%	2.02%
公用事业	6.11%	5.95%	4.23%	7.22%

沪深300行业权重占比



权重最大10只股票

沪深300			中证800			上证指数			上证180		
股票简称	收盘价(元)	涨跌幅	股票简称	收盘价(元)	涨跌幅	股票简称	收盘价(元)	涨跌幅	股票简称	收盘价(元)	涨跌幅
中国石化	25.81	36.27%	中国石化	25.81	36.27%	工商银行	8.74	32.22%	中国石化	25.81	36.27%
中信证券	105.93	9.53%	中信证券	105.93	9.53%	中国石化	25.81	36.27%	中信证券	105.93	9.53%
民生银行	16.99	7.46%	民生银行	16.99	7.46%	中国人寿	74.59	19.52%	民生银行	16.99	7.46%
万科A	38.93	28.91%	万科A	38.93	28.91%	中国神华	81.69	120.84%	招商银行	45.47	18.81%
招商银行	45.47	18.81%	招商银行	45.47	18.81%	中国神华	7.14	20.40%	浦发银行	58.79	11.98%
浦发银行	58.79	11.98%	浦发银行	58.79	11.98%	中国平安	139.86	3.64%	中国平安	139.86	3.64%
中国平安	139.86	3.64%	中国平安	139.86	3.64%	招商银行	45.47	18.81%	宝钢股份	18.51	1.76%
宝钢股份	18.51	1.76%	宝钢股份	18.51	1.76%	中国铝业	49.68	4.36%	长江电力	21.48	11.18%
长江电力	21.48	11.18%	长江电力	21.48	11.18%	交通银行	16.81	29.81%	工商银行	8.74	32.22%
工商银行	8.74	32.22%	工商银行	8.74	32.22%	中国远洋	58.25	29.27%	中国神华	81.69	120.84%

涨幅最低10只股票

沪深300			中证800			上证指数			上证180		
股票简称	收盘价(元)	涨幅									
海欣股份	11.68	-27.86%	胜利股份	12.35	-30.23%	*ST金瑞	8.63	-34.07%	海欣股份	11.68	-27.86%
东莞控股	10.48	-27.77%	岳阳纸业	29.75	-28.79%	ST卧龙	12.90	-31.89%	航天长峰	10.68	-26.80%
长安汽车	17.45	-25.11%	东方金钰	11.11	-28.41%	北矿磁材	8.58	-29.21%	广电电子	6.58	-25.57%
上海贝岭	7.64	-23.60%	汇通能源	13.81	-27.96%	*ST秦岭	5.79	-28.96%	国旅联合	7.58	-24.43%
大众公用	14.17	-23.36%	海欣股份	11.68	-27.86%	岳阳纸业	29.75	-28.79%	上海贝岭	7.64	-23.60%
国阳新能	52.80	-23.21%	东莞控股	10.48	-27.77%	力诺太阳	9.69	-28.49%	大众公用	14.17	-23.36%
东方电子	5.68	-22.83%	赛迪传媒	9.05	-27.77%	东方金钰	11.11	-28.41%	广电信息	8.39	-23.31%
航天机电	10.81	-22.79%	天方药业	6.27	-27.76%	汇通能源	13.81	-27.96%	国阳新能	52.80	-23.21%
海虹控股	11.91	-22.66%	航天科技	11.02	-27.74%	马龙产业	11.03	-27.86%	长电科技	13.87	-23.20%
强生控股	10.16	-22.62%	浙江东方	10.66	-27.29%	海欣股份	11.68	-27.86%	航天机电	10.81	-22.79%

涨幅最高10只股票

沪深300			中证800			上证指数			上证180		
股票简称	收盘价(元)	涨幅	股票简称	收盘价(元)	涨幅	股票简称	收盘价(元)	涨幅	股票简称	收盘价(元)	涨幅
中国神华	81.69	120.84%	中国神华	81.69	120.84%	中国神华	81.69	120.84%	中国神华	81.69	120.84%
东方铝业	30.36	38.00%	银泰股份	15.81	60.18%	银泰股份	15.81	60.18%	浙江医药	17.79	47.76%
中国石化	25.81	36.27%	浙江医药	17.79	47.76%	浙江医药	17.79	47.76%	中国石化	25.81	36.27%
工商银行	8.74	32.22%	新和成	24.14	41.67%	科达股份	26.97	41.65%	工商银行	8.74	32.22%
农产品	28.50	30.14%	东方铝业	30.36	38.00%	华新B股	3.70	38.52%	川投能源	19.75	30.79%
交通银行	16.81	29.81%	中国石化	25.81	36.27%	中国石化	25.81	36.27%	交通银行	16.81	29.81%
万科A	38.93	28.91%	文山电力	19.01	33.78%	江山股份	21.88	35.65%	天威保变	54.73	28.44%
天威保变	54.73	28.44%	昆明机床	36.14	33.51%	鼎盛天工	19.48	33.88%	贵州茅台	191.01	26.94%
海通证券	63.81	27.52%	工商银行	8.74	32.22%	文山电力	19.01	33.78%	金地集团	68.05	26.77%
中联重科	55.65	27.46%	川投能源	19.75	30.79%	昆明机床	36.14	33.51%	原水股份	20.99	25.69%

贡献度最大5只股票

沪深300			中证800			上证指数			上证180		
股票简称	收盘价(元)	涨幅	股票简称	收盘价(元)	涨幅	股票简称	收盘价(元)	涨幅	股票简称	收盘价(元)	涨幅
中国石化	25.81	-27.86%	中国石化	25.81	-27.86%	工商银行	8.74	-27.86%	中国石化	25.81	-27.86%
万科A	38.93	-27.77%	万科A	38.93	-27.77%	中国石化	25.81	-27.77%	招商银行	45.47	-27.77%
招商银行	45.47	-25.11%	招商银行	45.47	-25.11%	中国人寿	74.59	-25.11%	工商银行	8.74	-25.11%
工商银行	8.74	-23.60%	工商银行	8.74	-23.60%	中国银行	7.14	-23.60%	中信证券	105.93	-23.60%
中信证券	105.93	-23.36%	中信证券	105.93	-23.36%	交通银行	16.81	-23.36%	浦发银行	58.79	-23.36%

沪深300成交量前10样本

证券简称	收盘价(元)	涨跌幅	成交额(亿元)
中国神华	81.69	120.84%	1243.20
中国石化	25.81	36.27%	787.99
万科A	38.93	28.91%	598.28
中国联通	10.59	13.38%	479.14
工商银行	8.74	32.22%	453.78
宝钢股份	18.51	1.76%	421.80
中国铝业	49.68	4.36%	407.00
民生银行	16.99	7.46%	403.08
中国银行	7.14	20.40%	345.89
招商银行	45.47	18.81%	329.55

沪深300换手率前10样本

证券简称	收盘价(元)	涨跌幅	换手率(%)
中国神华	81.69	120.84%	124.43
盐田港	19.3	9.66%	115.88
海通证券	63.81	27.52%	114.32
兖州煤业	23.2	1.22%	108.70
澄星股份	9.55	-8.96%	106.58
招商轮船	14.29	5.46%	104.83
中国银行	7.14	20.40%	99.40
交通银行	16.81	29.81%	97.20
辽通化工	12.52	-10.89%	91.38
铜陵有色	33.33	5.47%	90.70