

# 中证指数月度报告(11月)

中证指数有限公司 上海證券報聯合推出

## 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	5701.49	5702.21	4619.51	4737.41	-951.14	-16.72%	3103.41	632.37
中证100	6047.23	6058.23	4890.89	5039.90	-987.87	-16.39%	1989.42	414.82
中证800	5403.55	5403.55	4457.13	4562.40	-829.51	-15.38%	4771.15	843.96
中证200	5377.68	5377.68	4369.15	4436.98	-940.60	-17.49%	1113.99	217.55
中证500	4557.64	4557.64	3996.16	4122.93	-427.25	-9.39%	1667.75	211.59
中证700	4991.78	4991.78	4223.79	4289.51	-698.71	-14.01%	2781.74	429.14
上证指数	5978.94	6005.13	4778.73	4871.78	-1082.99	-18.19%	4577.30	790.18
上证180	12840.44	12867.39	10464.73	10754.12	-2046.52	-15.99%	2301.21	443.40
上证50	4648.69	4668.73	3757.96	3880.34	-747.44	-16.15%	1503.61	293.47
上证红利	5003.72	5033.34	3979.76	4069.79	-860.18	-17.45%	561.78	98.07
深证成指	19554.58	19559.42	15189.43	15637.66	-3893.50	-19.93%	433.82	119.14

在11月份,市场各主要指数均延续了10月中旬以来的震荡下跌态势,沪深300指数开盘5701.49点,最低下探4619.51点,最高5702.21点,报收于4737.408点,较10月底下跌951.14点,跌幅16.72%,创下沪深300发布以来的单月最大跌幅记录。小盘指数中证500跌幅相对较小。两市A股共成交24111亿元,日均成交1096亿元,比上月下降40.64%,亦为最近一年来的新低。

## 阶段收益情况

	11月	10月	最近3个月	最近半年	最近1年	年初至今
沪深300	-16.72%	1.93%	-10.56%	20.61%	176.34%	132.11%
中证100	-16.39%	5.57%	-7.63%	30.07%	173.55%	121.97%
中证800	-15.38%	-0.71%	-11.77%	14.44%	171.24%	134.10%
中证200	-17.49%	-5.15%	-16.45%	4.42%	177.88%	149.76%
中证500	-9.39%	-10.49%	-15.82%	-3.39%	153.90%	138.85%
中证700	-14.01%	-7.52%	-16.16%	0.69%	166.22%	144.61%
上证指数	-18.19%	7.25%	-6.65%	18.54%	132.07%	82.09%
上证180	-15.99%	3.10%	-9.06%	24.55%	171.96%	124.97%
上证50	-16.15%	7.44%	-6.50%	31.97%	172.26%	114.94%
上证红利	-17.45%	1.03%	-10.39%	14.28%	167.98%	127.52%

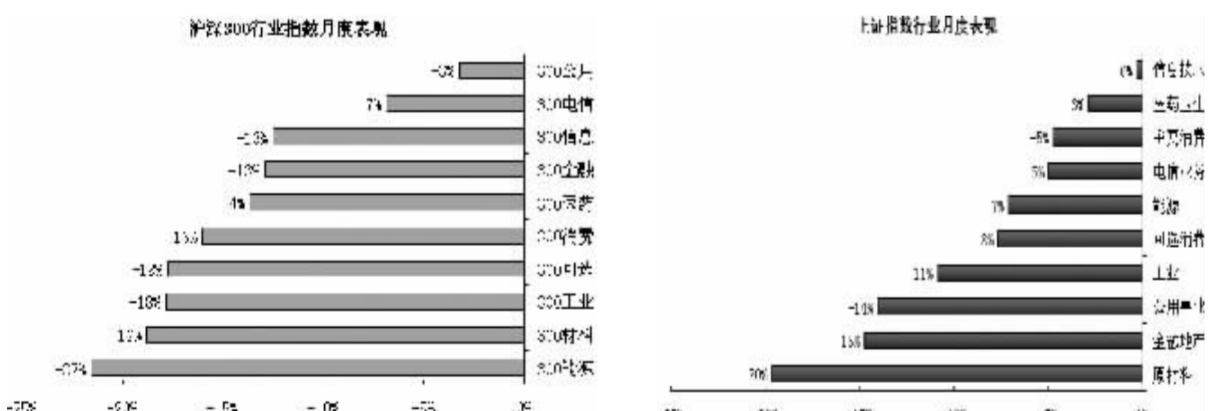
## 阶段波动情况

	11月	10月	最近3个月	最近半年	最近1年	年初至今
沪深300	34.49%	30.21%	31.52%	36.53%	36.46%	36.99%
中证100	35.26%	30.78%	32.03%	35.76%	36.14%	36.48%
中证800	33.73%	30.50%	31.13%	37.30%	36.88%	37.57%
中证200	35.84%	32.32%	32.95%	40.52%	39.68%	40.61%
中证500	34.21%	38.01%	33.69%	43.09%	41.25%	42.45%
中证700	34.85%	34.27%	32.81%	41.33%	40.09%	41.15%
上证指数	35.33%	33.82%	32.99%	35.43%	34.94%	35.45%
上证180	35.07%	31.39%	32.10%	36.07%	36.25%	36.73%
上证50	36.10%	32.28%	32.92%	35.46%	36.19%	36.45%
上证红利	37.77%	42.92%	39.66%	42.71%	42.12%	42.91%

## 行业指数表现

	沪深300	中证800	上证指数	上证180
能源	-18.80%	-13.89%	-7.10%	-14.90%
原材料	-21.54%	-18.38%	-19.64%	-21.08%
工业	-13.63%	-10.87%	-10.88%	-12.28%
可选消费	-12.88%	-9.81%	-7.67%	-10.86%
主要消费	-12.52%	-10.05%	-4.73%	-9.91%
医药卫生	-17.80%	-9.40%	-2.91%	-4.30%
金融地产	-17.73%	-17.06%	-14.72%	-15.56%
信息技术	-3.26%	-1.94%	-0.30%	0.01%
电信业务	-6.88%	-6.94%	-4.98%	-5.84%
公用事业	-16.04%	-13.34%	-14.03%	-14.78%

在11月份,沪深300行业指数全部下跌,其中300材料指数跌幅最大,跌21.54%,300能源指数跌幅也达到18.8%,仅次于原材料指数,300金融与300医药指数跌幅也超过17%。信息技术与电信行业等前期涨幅较小行业在11月份中跌幅相对小些,300信息下跌3.26%,300电信下跌6.88%。



## 行业对指数贡献度

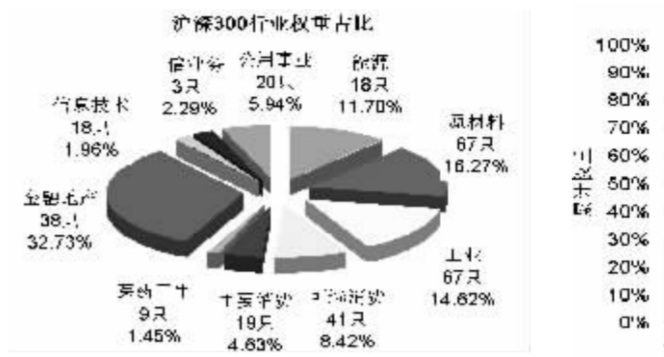
	沪深300	中证800	上证指数	上证180
能源	10.89%	9.98%	21.35%	14.77%
原材料	21.83%	22.78%	15.13%	18.07%
工业	11.63%	12.32%	11.09%	12.34%
可选消费	6.79%	7.14%	2.71%	4.68%
主要消费	3.60%	3.63%	0.88%	2.43%
医药卫生	1.33%	1.77%	0.31%	0.31%
金融地产	36.45%	35.29%	43.81%	39.23%
信息技术	0.33%	0.37%	0.02%	0.00%
电信业务	1.06%	1.09%	0.48%	1.07%
公用事业	6.09%	5.63%	4.21%	7.08%

## 行业市场估值

	P/E	P/B	EPS	ROE	ROA
沪深300	42.63	6.13	0.44	14.38%	2.59%
能源	33.25	7.98	0.92	23.99%	20.04%
原材料	24.21	4.21	0.83	17.38%	10.02%
工业	37.83	5.66	0.49	14.96%	8.27%
可选消费	39.66	4.49	0.48	11.33%	6.23%
主要消费	71.24	9.2	0.45	12.91%	9.80%
医药卫生	33.93	6.24	0.69	18.40%	11.81%
金融地产	33.08	4.43	0.42	13.39%	1.41%
信息技术	46.7	4.85	0.33	10.39%	6.70%
电信业务	34.75	2.45	0.33	7.05%	6.72%
公用事业	26.61	3.06	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	11.70%	9.97%	33.66%	14.39%
原材料	16.27%	17.19%	8.62%	12.44%
工业	14.62%	15.72%	11.41%	14.58%
可选消费	8.42%	10.10%	3.96%	6.26%
主要消费	4.63%	5.02%	2.08%	3.56%
医药卫生	1.45%	2.61%	1.19%	1.04%
金融地产	32.73%	28.70%	33.31%	36.58%
信息技术	1.96%	2.65%	0.93%	1.55%
电信业务	2.29%	2.19%	1.09%	2.66%
公用事业	5.94%	5.85%	3.36%	6.95%



## 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	21.12	-18.17%	中国石化	21.12	-18.17%	中国石化	21.12	-18.17%	中国石化	21.12	-18.17%
中信证券	83.89	-20.81%	中信证券	83.89	-20.81%	工商银行	7.99	-8.58%	中信证券	83.89	-20.81%
浦发银行	51.89	-11.74%	浦发银行	51.89	-11.74%	中国石化	21.12	-18.17%	浦发银行	51.89	-11.74%
民生银行	15.10	-11.12%	民生银行	15.10	-11.12%	中国银行	6.45	-9.66%	民生银行	15.10	-11.12%
万科A	31.55	-18.96%	万科A	31.55	-18.96%	中国人寿	54.83	-26.49%	招商银行	39.25	-13.68%
招商银行	39.25	-13.68%	招商银行	39.25	-13.68%	中国神华	64.35	-21.23%	中国联通	9.85	-6.99%
中国联通	9.85	-6.99%	中国联通	9.85	-6.99%	中国平安	108.73	-22.26%	中国平安	108.73	-22.26%
中国平安	108.73	-22.26%	中国平安	108.73	-22.26%	招商银行	39.25	-13.68%	宝钢股份	14.52	-21.56%
宝钢股份	14.52	-21.56%	宝钢股份	14.52	-21.56%	交通银行	14.51	-13.68%	工商银行	7.99	-8.58%
工商银行	7.99	-8.58%	工商银行	7.99	-8.58%	中国铝业	36.99	-25.54%	长江电力	16.78	-21.88%

## 跌幅最大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
招商地产	59.81	-40.18%	中钨高新	18.09	-44.86%	宝光股份	8.22	-41.70%	中铁二局	20.68	-35.54%
锌业股份	15.12	-39.86%	招商地产	59.81	-40.18%	包钢稀土	35.36	-38.96%	吉恩镍业	81.09	-34.39%
中色股份	33.61	-39.22%	锌业股份	15.12	-39.86%	东盛科技	12.33	-36.80%	金地集团	44.88	-34.05%
中金岭南	37.24	-37.93%	中色股份	33.61	-39.22%	酒钢宏兴	20.18	-36.56%	江西铜业	45.45	-33.04%
石油济柴	31.48	-37.66%	中金岭南	37.24	-37.93%	中铁二局	20.68	-35.54%	中金黄金	84.78	-32.66%
酒钢宏兴	20.18	-36.56%	石油济柴	31.48	-37.66%	华发股份	37.82	-34.85%	驰宏锌锗	69.29	-32.51%
云南铜业	50.45	-36.55%	酒钢宏兴	20.18	-36.56%	吉恩镍业	81.09	-34.39%	株冶集团	22.35	-32.11%
中铁二局	20.68	-35.54%	云南铜业	50.45	-36.55%	金地集团	44.88	-34.05%	辽宁成大	43.86	-31.32%
锡业股份	55.80	-35.04%	中铁二局	20.68	-35.54%	江西铜业	45.45	-33.04%	三一重工	43.94	-31.24%
吉恩镍业	81.09	-34.39%	锡业股份	55.80	-35.04%	中金黄金	84.78	-32.66%	中华企业	19.95	-30.87%

## 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
中国石化	31.52	88.74%	中国石化	31.52	88.74%	ST华侨	6.34	181.78%	中国石化	31.52	88.74%
烽火通信	15.18	21.25%	川投能源	26.97	36.56%	中国石化	31.52	88.74%	川投能源	26.97	36.56%
双鹤药业	26.47	15.14%	九发股份	11.82	32.36%	哈飞股份	30.93	81.30%	烽火通信	15.18	21.25%
航天晨光	15.74	13.16%	锡化氯碱	13.40	30.35%	ST新智	15.69	55.35%	航天长峰	12.40	16.10%
南方航空	25.64	12.06%	益佰制药	15.08	23.91%	云南城投	12.40	49.76%	南方航空	25.64	12.06%
华北制药	9.08	10.46%	华联股份	11.79	23.46%	*ST潜药	11.11	39.92%	华北制药	9.08	10.46%
洪都航空	38.19	9.99%	江苏索普	8.34	23.01%	川投能源	26.97	36.56%	长电科技	15.29	10.24%
安泰科技	16.41	9.33%	烽火通信	15.18	21.25%	ST长运	3.77	34.16%	洪都航空	38.19	9.99%
航天信息	53.55	7.90%	威海广泰	51.80	21.08%	九发股份	11.82	32.36%	航天信息	53.55	7.90%
东软股份	42.33	7.85%	中纺投资	9.70	19.02%	大橡塑	14.10	31.16%	上海梅林	11.77	7.78%

## 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	贡献度	股票简称	收盘价(元)	涨幅	贡献度	股票简称	收盘价(元)	涨幅	贡献度
中信证券	83.89	-20.81%	6.42%	中信证券	83.89	-20.81%	5.71%	中国人寿	54.83	-26.49%	11.12%
中国石化	21.12	-18.17%	5.96%	中国石化	21.12	-18.17%	5.29%	中国石化	21.12	-18.17%	9.87%