

中证指数月度报告(12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	4714.92	5391.67	4689.52	5338.28	600.87	12.68%	3537.04	711.51
中证100	5012.54	5640.65	4983.09	5578.45	538.55	10.69%	2096.87	441.65
中证800	4542.84	5252.94	4521.02	5205.74	643.34	14.10%	5997.27	1034.87
中证200	4423.42	5265.65	4404.12	5219.56	782.58	17.64%	1440.17	269.86
中证500	4113.21	4987.21	4101.10	4947.60	824.67	20.00%	2460.23	323.36
中证700	4277.76	5133.79	4262.65	5092.24	802.73	18.71%	3900.40	593.22
上证指数	4838.56	5336.50	4798.01	5261.56	389.78	8.00%	6257.53	986.61
上证180	10697.37	12153.70	10640.33	12024.60	1270.48	11.81%	2560.97	489.21
上证50	3859.85	4280.73	3826.92	4226.76	346.42	8.93%	1445.50	286.45
上证红利	4063.01	4754.12	4026.92	4661.24	591.45	14.53%	628.62	105.71
深证成指	15580.24	17856.94	15477.47	17700.62	2062.96	13.19%	528.90	142.83

经过两个月的下跌后12月市场震荡回升,沪深300指数与上证指数分别上涨600.87点与389.78点,涨幅分别为12.68%与8.00%,均顺利收复5000点。在中证规模指数中,小盘指数中证500表现突出,月涨幅达20%,远超大盘指数涨幅。两市A股共成交27755亿元,日均成交1388亿元,比11月增加27%。

阶段收益情况

	12月	11月	近3个月	近半年	近1年	年初至12月末
沪深300	12.68%	-16.72%	-4.35%	41.82%	161.55%	161.55%
中证100	10.69%	-16.39%	-2.30%	45.97%	145.69%	145.69%
中证800	14.10%	-15.38%	-4.14%	40.72%	167.11%	167.11%
中证200	17.64%	-17.49%	-7.94%	34.67%	193.81%	193.81%
中证500	20.00%	-9.39%	-2.68%	37.99%	186.63%	186.63%
中证700	18.71%	-14.01%	-5.59%	36.19%	190.38%	190.38%
上证指数	8.00%	-18.19%	-5.24%	37.71%	96.66%	96.66%
上证180	11.81%	-15.99%	-3.15%	43.95%	151.55%	151.55%
上证50	8.93%	-16.15%	-1.87%	44.96%	134.13%	134.13%
上证红利	14.53%	-17.45%	-4.48%	47.09%	160.59%	160.59%

阶段波动情况

	12月	11月	近3个月	近半年	近1年	年初至12月末
沪深300	27.24%	34.49%	31.55%	32.89%	36.27%	36.27%
中证100	28.39%	35.26%	32.50%	33.15%	35.84%	35.84%
中证800	25.72%	33.73%	30.70%	32.78%	36.76%	36.76%
中证200	26.10%	35.84%	32.31%	34.76%	39.70%	39.70%
中证500	21.76%	34.21%	32.06%	35.45%	41.27%	41.27%
中证700	23.89%	34.85%	31.71%	34.71%	40.12%	40.12%
上证指数	25.96%	35.33%	32.83%	31.90%	34.64%	34.64%
上证180	27.75%	35.07%	32.25%	32.87%	36.03%	36.03%
上证50	28.58%	36.10%	33.34%	33.17%	35.79%	35.79%
上证红利	30.94%	37.77%	37.92%	38.52%	42.00%	42.00%

行业指数表现

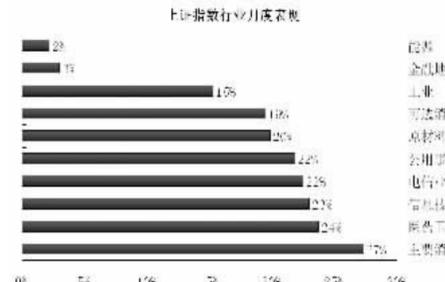
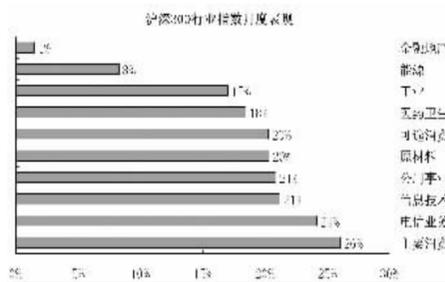
	沪深300	中证800	上证指数	上证180
能源	8.29%	9.10%	2.21%	8.76%
原材料	20.33%	21.75%	19.84%	19.76%
工业	17.02%	17.27%	15.29%	17.22%
可选消费	20.30%	21.12%	19.46%	19.58%
主要消费	26.04%	26.47%	27.32%	27.63%
医药卫生	18.44%	24.19%	23.75%	25.95%
金融地产	1.50%	2.80%	2.99%	2.79%
信息技术	21.20%	22.44%	22.99%	24.86%
电信业务	24.15%	24.39%	22.47%	22.45%
公用事业	20.87%	21.63%	21.83%	22.81%

在12月份,沪深300行业指数悉数上涨,其中沪深300主要消费行业涨幅达26.04%,在全部10个行业指数中列第一位;金融地产、能源等行业指数表现相对落后。

行业对指数贡献度

	沪深300	中证800	上证指数	上证180
能源	6.80%	5.54%	7.62%	9.10%
原材料	25.81%	25.41%	20.23%	19.62%
工业	19.51%	18.30%	26.78%	20.25%
可选消费	13.31%	14.50%	9.26%	9.69%
主要消费	9.99%	9.55%	7.30%	8.35%
医药卫生	2.17%	4.47%	3.48%	2.26%
金融地产	3.22%	4.59%	10.83%	6.95%
信息技术	3.23%	4.03%	2.60%	3.18%
电信业务	4.43%	3.72%	3.00%	4.87%
公用事业	11.53%	9.88%	8.89%	15.72%

原材料行业对沪深300指数的贡献度最高,为25.81%,工业行业的贡献度也达到了19.51%;权重最大的金融地产行业的贡献度仅为3.22%,略高于医药卫生行业。

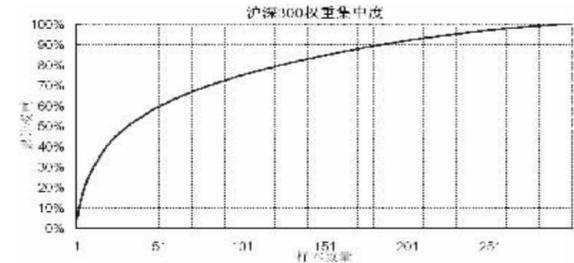
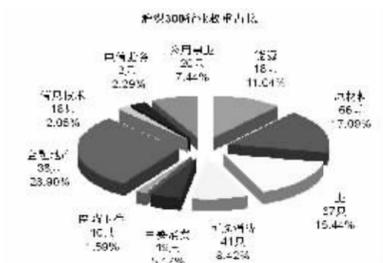
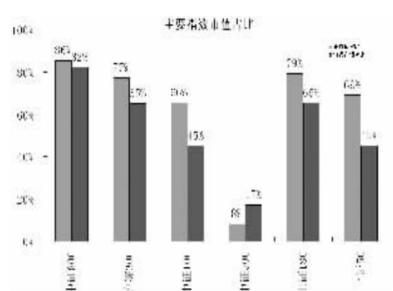


行业市场估值

	P/E	P/B	EPS	ROE	ROA
沪深300	35.59	5.84	0.57	16.40%	3.33%
能源	34.29	7.87	0.91	22.96%	18.49%
原材料	28.19	5.19	0.84	18.40%	10.53%
工业	44.46	6.66	0.49	14.99%	8.30%
可选消费	47.16	5.35	0.48	11.34%	6.24%
主要消费	90.37	11.66	0.45	12.91%	9.80%
医药卫生	37.22	6.94	0.75	18.64%	12.48%
金融地产	34.87	4.91	0.41	14.07%	1.42%
信息技术	55.72	5.89	0.33	10.56%	6.81%
电信业务	43.01	3.03	0.33	7.05%	6.72%
公用事业	32.55	3.82	0.50	11.73%	6.58%

行业权重占比

	沪深300	中证800	上证指数	上证180
能源	11.04%	9.36%	31.54%	13.63%
原材料	17.09%	17.98%	9.31%	13.03%
工业	15.44%	16.30%	13.46%	15.44%
可选消费	8.82%	10.56%	4.35%	6.50%
主要消费	5.17%	5.55%	2.41%	3.97%
医药卫生	1.59%	2.84%	1.34%	1.14%
金融地产	28.90%	25.25%	33.03%	32.71%
信息技术	2.05%	2.77%	1.03%	1.68%
电信业务	2.47%	2.35%	1.22%	2.85%
公用事业	7.44%	7.03%	3.72%	9.05%



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	23.43	10.94%	中国石化	23.43	10.94%	中国石油	30.96	-1.78%	中国石化	23.43	10.94%
中信证券	89.27	6.41%	中信证券	89.27	6.41%	工商银行	8.13	1.75%	中信证券	89.27	6.41%
浦发银行	52.80	1.75%	浦发银行	52.80	1.75%	中国石化	23.43	10.94%	浦发银行	52.80	1.75%
民生银行	14.82	-1.85%	民生银行	14.82	-1.85%	中国人寿	57.94	5.67%	民生银行	14.82	-1.85%
招商银行	39.63	0.97%	招商银行	39.63	0.97%	中国银行	6.61	2.48%	招商银行	39.63	0.97%
万科A	28.84	-8.59%	万科A	28.84	-8.59%	中国神华	65.61	1.96%	中国联通	12.08	22.64%
中国联通	12.08	22.64%	中国联通	12.08	22.64%	中国平安	106.10	-2.42%	宝钢股份	17.44	20.11%
宝钢股份	17.44	20.11%	宝钢股份	17.44	20.11%	招商银行	39.63	0.97%	长江电力	19.49	16.15%
长江电力	19.49	16.15%	长江电力	19.49	16.15%	交通银行	15.62	7.65%	贵州茅台	230.00	32.57%
贵州茅台	230.00	32.57%	贵州茅台	230.00	32.57%	中国铝业	39.39	6.49%	大唐发电	20.62	41.52%

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
唐钢股份	24.98	46.08%	西单商场	18.45	85.99%	ST长运	9.08	140.85%	中体产业	37.91	72.95%
湖北宜化	23.01	45.73%	六国化工	17.40	60.37%	中国中铁	11.49	139.38%	新安股份	67.13	44.58%
新安股份	67.13	44.58%	华邦制药	39.10	54.06%	西单商场	18.45	85.99%	海正药业	17.89	43.69%
中视传媒	35.79	43.27%	宏图高科	26.90	50.95%	中海集运	12.15	83.53%	特变电工	32.33	43.31%
澄星股份	11.68	41.92%	广东明珠	14.70	49.54%	海星科技	12.85	76.51%	中视传媒	35.79	43.27%
大唐发电	20.62	41.52%	丽珠集团	42.80	48.87%	中体产业	37.91	72.95%	好当家	16.74	42.23%
综艺股份	29.49	41.24%	新中基	17.72	48.66%	兴发集团	23.91	72.01%	大唐发电	20.62	41.52%
酒钢宏兴	28.28	40.14%	八一钢铁	22.93	47.37%	新五丰	15.96	68.35%	综艺股份	29.49	41.24%
健康元	26.66	38.42%	山东海龙	23.13	47.32%	西水股份	50.99	65.39%	浙江医药	19.40	39.77%
深宝安A	15.90	38.26%	江苏索普	12.24	46.76%	东盛科技	20.21	63.91%	海欣股份	13.98	37.46%

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)	跌幅	股票简称	收盘价(元)	跌幅	股票简称	收盘价(元)	跌幅	股票简称	收盘价(元)	跌幅
金地集团	40.80	-9.09%	九发股份	9.53	-19.37%	九发股份	9.53	-19.37%	金地集团	40.80	-9.09%
万科A	28.84	-8.59%	中达股份	7.85	-12.68%	江苏申龙	8.47	-14.53%	兴业银行	51.86	-8.21%
兴业银行	51.86	-8.21%	香江控股	24.57	-11.01%	GST酒花	12.27	-13.71%	保利地产	64.82	-5.21%
保利地产	64.82	-5.21%	金地集团	40.80	-9.09%	中达股份	7.85	-12.68%	中国平安	106.10	-2.42%
金牛能源	28.11	-3.04%	万科A	28.84	-8.59%	香江控股	24.57	-11.01%	民生银行	14.82	-1.85%
泛海建设	45.50	-2.90%	兴业银行	51.86	-8.21%	金地集团	40.80	-9.09%	中国石化	30.96	-1.78%
中国平安	106.10	-2.42%	华业地产	15.76	-7.89%	兴业银行	51.86	-8.21%	华夏银行	19.16	-1.69%
民生银行	14.82	-1.85%	百利电气	15.11	-5.97%	华业地产	15.76	-7.89%	宏达股份	80.20	0.00%
中国石化	30.96	-1.78%	保利地产	64.82	-5.21%	园城股份	11.48	-7.34%	桂冠电力	11.95	0.00%
华夏银行	19.16	-1.69%	华发股份	36.51	-3.46%	鲁银投资	9.84	-6.64%	洪都航空	38.19	0.00%

正向贡献度最大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
大唐发电	20.62	41.52%	4.60%	大唐发电	20.62	41.52%	3.33%	中国石化	23.43	10.94%	7.40%
中国石化	23.43	10.94%	3.79%	中国石化	23.43	10.94%	2.74%	中国中铁	11.49	46.74%	3.79%
贵州茅台	230	32.57%	3.74%	贵州茅台	230	32.57%	2.71%	大唐发电	20.62	41.52%	2.99%
中国联通	12.08	22.64%	3.06%	中国联通	12.08	22.64%	2.22%	贵州茅台	230	32.57%	2.92%
宝钢股份	17.44	20.11%	2.60%	宝钢股份	17.44	20.11%	1.88%	中国人寿	57.94	5.67%	2.83%

反向贡献度最大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
万科A	28.84	-8.59%	-1.58%	万科A	28.84	-8.59%	-1.15%	中国石化	30.96	-1.78%	-3.85%
兴业银行	51.86	-8.21%	-0.45%	兴业银行	51.86	-8.21%	-0.33%	兴业银行	51.86	-8.21%	-0.92%
民生银行	14.82	-1.85%	-0.42%	民生银行	14.82	-1.85%	-0.30%	中国平安	106.1	-2.42%	-0.53%
金地集团	40.8	-9.09%	-0.26%	金地集团	40.8	-9.09%	-0.19%	保利地产	64.82	-5.21%	-0.18%
中国平安	106.1	-2.42%	-0.26%	中国平安	106.1	-2.42%	-0.19%	民生银行	14.82	-1.85%	-0.17%

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)	成交量(万手)
万科A	28.84	-8.59%	470.92	1602.40
中国石化	30.96	-1.78%	388.85	1257.