

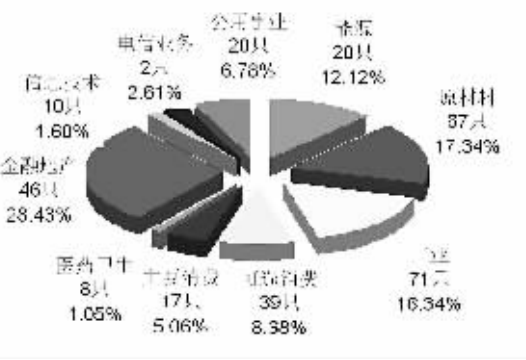
中证指数月度报告(1月)

中证指数有限公司 上海证券报联合推出

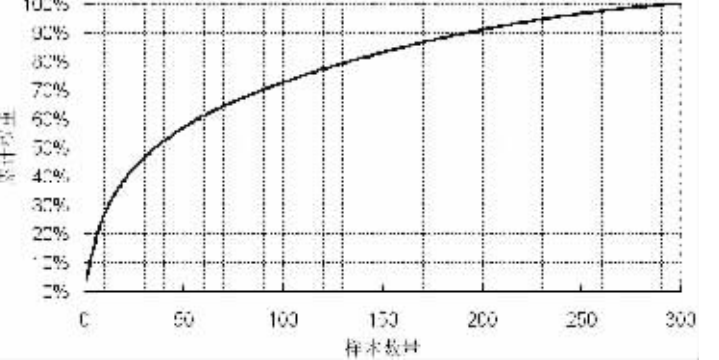
主要股票指数月度表现

	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	5349.76	5756.92	4606.14	4620.40	-717.87	-13.45%	111357	24161
中证100	5585.55	5965.73	4641.38	4684.16	-894.30	-16.03%	62333	14271
中证800	5217.93	5644.37	4578.43	4583.53	-622.21	-11.95%	189814	35741
中证200	5241.62	5779.73	4840.72	4845.11	-374.75	-7.18%	49024	9890
中证500	4963.05	5495.39	4624.94	4663.42	-284.19	-5.74%	78457	11580
中证700	5111.23	5646.33	4756.96	4759.86	-332.39	-6.53%	127481	21470
300成长	5726.20	6125.89	4773.62	4807.00	-915.49	-16.00%	33324	10072
300价值	5700.30	6150.66	4750.24	4784.79	-902.69	-15.87%	53597	9658
上证指数	5265.00	5522.78	4330.70	4383.39	-878.17	-16.69%	177173	30755
上证180	12047.40	12884.16	10172.42	10217.95	-1806.65	-15.02%	85291	16581
上证50	4230.81	4524.29	3459.87	3497.92	-728.83	-17.24%	50797	10137
红利指数	4670.13	5062.34	3928.97	3986.14	-675.10	-14.48%	21060	3584
深证成指	17731.84	19219.89	17593.28	15857.71	-1842.91	-10.41%	15031	4285

沪深300行业权重占比



沪深300权重集中度



股票指数阶段收益情况

	1月	去年12月	3个月	半年	1年	年初至1月末
沪深300	-13.45%	12.68%	-18.78%	22.75%	93.70%	-13.45%
中证100	-16.03%	10.69%	-22.29%	22.57%	80.23%	-16.03%
中证800	-11.95%	14.10%	-14.99%	23.90%	98.50%	-11.95%
中证200	-7.18%	17.64%	-9.90%	25.01%	123.75%	-7.18%
中证500	-5.74%	20.00%	2.49%	30.06%	117.62%	-5.74%
中证700	-6.53%	18.71%	-4.58%	27.30%	120.77%	-6.53%
上证指数	-16.69%	8.00%	-26.39%	14.73%	57.32%	-16.69%
上证180	-15.02%	11.81%	-20.18%	22.32%	84.94%	-15.02%
上证50	-17.24%	8.93%	-24.41%	19.96%	70.39%	-17.24%
上证红利	-14.48%	14.53%	-19.14%	25.79%	88.19%	-14.48%

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	16.96	-27.61%	中国石化	16.96	-27.61%	中国石化	16.96	-27.61%	中国石化	16.96	-27.61%
中信证券	68.12	-23.69%	中信证券	68.12	-23.69%	中信证券	68.12	-23.69%	中信证券	68.12	-23.69%
浦发银行	46.00	-12.88%	浦发银行	46.00	-12.88%	浦发银行	46.00	-12.88%	浦发银行	46.00	-12.88%
中国神华	56.46	-13.95%	中国神华	56.46	-13.95%	中国神华	56.46	-13.95%	中国神华	56.46	-13.95%
民生银行	12.00	-19.03%	民生银行	12.00	-19.03%	民生银行	12.00	-19.03%	民生银行	12.00	-19.03%
万科A	26.05	-9.67%	万科A	26.05	-9.67%	万科A	26.05	-9.67%	万科A	26.05	-9.67%
招商银行	32.52	-17.94%	招商银行	32.52	-17.94%	招商银行	32.52	-17.94%	招商银行	32.52	-17.94%
中国联通	11.51	-4.72%	中国联通	11.51	-4.72%	中国联通	11.51	-4.72%	中国联通	11.51	-4.72%
宝钢股份	15.52	-11.01%	宝钢股份	15.52	-11.01%	宝钢股份	15.52	-11.01%	宝钢股份	15.52	-11.01%

股票指数阶段波动情况

	1月	去年12月	3个月	半年	1年	年初至1月末
沪深300	44.15%	27.24%	36.97%	34.19%	37.03%	44.15%
中证100	43.31%	28.39%	37.12%	34.80%	36.66%	43.31%
中证800	45.18%	25.72%	36.80%	33.91%	37.53%	45.18%
中证200	48.28%	26.10%	39.01%	35.59%	40.21%	48.28%
中证500	52.22%	21.76%	39.17%	36.49%	42.13%	52.22%
中证700	49.87%	23.89%	38.83%	35.64%	40.79%	49.87%
上证指数	40.45%	25.96%	35.24%	33.33%	35.12%	40.45%
上证180	43.60%	27.75%	37.00%	34.45%	36.80%	43.60%
上证50	43.30%	28.58%	37.33%	35.25%	36.59%	43.30%
上证红利	48.68%	30.94%	40.76%	39.65%	42.40%	48.68%

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
许继电气	26.18	38.52%	冠农股份	70.28	63.59%	*ST长运	18.74	106.39%	北大荒	19.23	26.51%
金牛能源	36.34	29.28%	复旦复华	12.60	59.29%	*ST沧化	9.52	84.50%	大同煤业	39.87	24.59%
华发股份	47.02	28.79%	许继电气	26.18	38.52%	威远生化	13.99	77.09%	山东黄金	199.00	18.24%
北大荒	19.28	26.51%	新赛股份	15.19	38.34%	敦煌种业	13.33	73.79%	洪都航空	45.98	17.47%
大同煤业	39.87	24.59%	龙元建设	18.79	34.79%	冠农股份	70.28	63.59%	云天化	61.90	13.73%
山东黄金	199.82	18.24%	金龙汽车	30.32	33.63%	复旦复华	12.60	59.29%	万业企业	23.72	13.14%
威孚高科	22.00	17.58%	风神股份	19.17	33.59%	新赛股份	15.19	38.34%	邯郸钢铁	9.35	11.84%
洪都航空	44.86	17.47%	红太阳	19.69	30.57%	龙元建设	18.79	34.79%	方正科技	8.46	11.56%
盐湖钾肥	90.00	15.56%	金牛能源	36.34	29.28%	金龙汽车	30.32	33.63%	亿阳信通	22.19	11.50%
湖北宜化	26.36	14.56%	华发股份	47.02	28.79%	风神股份	19.17	33.59%	上实发展	51.34	10.97%

中证债券指数表现

	去年12月收盘	1月收盘	涨跌点数	涨跌幅	成交金额(亿元)	久期	修正久期	凸性	到期收益率
中证全债	111.78	112.68	0.90	0.81%	2883.39	6.54	6.25	67.31	4.44%
中证3债	114.90	115.43	0.53	0.46%	1628.74	1.83	1.77	5.13	3.86%
中证7债	112.59	113.45	0.86	0.76%	756.07	4.39	4.21	23.61	4.30%
中证10债	109.35	110.27	0.92	0.84%	312.88	7.63	7.29	67.55	4.73%
中证10+债	104.42	105.70	1.28	1.23%	185.71	11.29	10.78	156.80	4.76%
中证国债	111.09	112.20	1.11	1.00%	717.32	6.95	6.65	73.59	4.26%
中证金融债	114.05	114.67	0.62	0.54%	1834.20	5.16	4.93	48.19	4.45%
中证企业债	113.28	113.30	0.02	0.02%	331.88	7.83	7.40	79.85	5.87%

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
上海航空	11.44	-34.52%	上海航空	11.44	-34.52%	上海航空	11.44	-34.52%	上海航空	11.44	-34.52%
中国平安	71.81	-32.32%	中国平安	71.81	-32.32%	中国平安	71.81	-32.32%	中国平安	71.81	-32.32%
中国人寿	39.40	-32.00%	中国人寿	39.40	-32.00%	中国人寿	39.40	-32.00%	中国人寿	39.40	-32.00%
东方航空	14.73	-30.81%	科学城	8.55	-30.56%	东方航空	14.73	-30.81%	东方航空	14.73	-30.81%
南方航空	20.06	-28.20%	物华股份	7.02	-29.02%	华盛达	12.09	-29.59%	南方航空	22.74	-28.20%
中国石化	16.96	-27.61%	南方航空	20.06	-28.20%	物华股份	7.02	-29.02%	中国石化	18.46	-27.61%
锌业股份	12.59	-27.48%	中国石化	16.96	-27.61%	南方航空	20.06	-28.20%	广船国际	63.61	-26.66%
津滨发展	11.01	-26.89%	石油济柴	27.80	-27.53%	中国石化	16.96	-27.61%	中国国航	23.49	-26.09%
广船国际	59.97	-26.66%	锌业股份	12.59	-27.48%	S前锋	30.32	-27.29%	中船股份	33.29	-26.07%
西山煤电	46.80	-26.26%	东方铝业	22.13	-27.11%	东盛科技	14.76	-26.97%	中铁二局	18.57	-25.33%

行业指数表现

	沪深300	中证800	上证指数	上证180
能源	-17.31%	-15.20%	-18.38%	-16.99%
原材料	-10.18%	-8.07%	-8.87%	-7.45%
工业	-13.39%	-10.94%	-13.73%	-15.79%
可选消费	-9.03%	-6.17%	-8.72%	-10.30%
主要消费	-10.79%	-6.37%	-2.67%	-7.36%
医药卫生	-7.83%	-7.35%	-7.12%	-9.26%
金融地产	-16.27%	-14.33%	-19.51%	-16.85%
信息技术	-5.54%	-2.42%	-3.85%	-3.12%
电信业务	-1.13%	-0.98%	-5.41%	-4.89%
公用事业	-16.21%	-14.62%	-14.96%	-15.46%

行业对指数贡献度

	沪深300	中证800	上证指数	上证180
能源	15.78%	14.60%	35.53%	18.08%
原材料	13.27%	13.90%	5.67%	7.20%
工业	16.44%	17.78%	11.96%	16.57%
可选消费	5.89%	6.03%	2.58%	4.63%
主要消费	4.10%	3.35%	0.46%	2.08%
医药卫生	0.62%	1.75%	0.66%	0.80%
金融地产	34.76%	32.83%	38.83%	39.78%
信息技术	0.67%	0.66%	0.28%	0.40%
电信业务	0.22%	0.23%	0.47%	1.01%
公用事业	8.26%	8.87%	3.55%	9.45%

正向贡献度最大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	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
中国石化	16.96	-27.61%	8.65%	中国石化	16.96	-27.61%	7.92%	中国石化	16.96	-27.61%	10.78%
中信证券	68.12	-23.69%	7.06%	中信证券	68.12	-23.69%	6.47%	中信证券	68.12	-23.69%	8.80%
民生银行	12.00	-19.03%	4.37%	民生银行	12.00	-19.03%	4.00%	工商银行	6.53	-19.68%	9.17%
招商银行	32.52	-17.94%	3.71%	招商银行	32.52	-17.94%	3.40%	中国人寿	39.40	-32.00%	7.47%
中国神华	56.46	-13.95%	3.43%	中国神华	56.46	-13.95%	3.41%	中国神华	56.46	-13.95%	4.27%
浦发银行	46.00	-12.88%	3.41%	浦发银行	46.00	-12.88%	3.12%	中国神华	56.46	-13.95%	3.69%
中国平安	71.81	-32.32%	2.94%	中国平安	71.81	-32.32%	2.69%	中国平安	71.81	-32.32%	3.66%
中国人寿	39.40	-32.00%	2.49%	中国人寿	39.40	-32.00%	2.29%	中国人寿	39.40	-32.00%	3.11%
大唐发电	16.11	-21.87%	2.37%	大唐发电	16.11	-21.87%	2.16%	招商银行	32.52	-17.94%	2.00%
工商银行	6.53	-19.68%	2.04%	工商银行	6.53	-19.68%	1.87%	工商银行	6.53	-19.68%	2.55%

沪深300行业估值

	P/E	P/B	EPS	ROE	ROA
沪深300	30.16	4.94	0.56	16.38%	3.33%
能源	28.10	6.43	0.90	22.90%	18.43%
原材料	25.34	4.69	0.82	18.50%	10.67%
工业	42.49	6.03	0.46	14.19%	7.52%
可选消费	40.48	4.76	0.50	11.76%	6.44%
主要消费	71.00	10.81	0.54	15.23%	11.80%
医药卫生	47.61	6.28	0.46	13.19%	9.09%
金融地产	28.44	4.02	0.40	14.13%	1.42%
信息技术	51.61	5.38	0.32	10.42%	6.44%
电信业务	41.85	2.97	0.33	7.10%	6.82%
公用事业	27.02	3.14	0.50	11.64%	6.54%

反向贡献度最大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	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
盐湖钾肥	90	15.56%	-0.86%	盐湖钾肥	90.19	15.56%	-0.78%	北大荒	19.28	26.51%	-0.24%
中兴通讯	71.18	11.76%	-0.62%	冠农股份	75.88	63.59%	-0.58%	大同煤业	39.87	24.59%	-0.23%
金牛能源	36.34	29.28%									