

中证指数月度报告(2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	4623.62	5062.26	4394.59	4674.55	54.15	1.17%	49737	10119
中证100	4688.31	5113.87	4377.14	4651.96	-32.20	-0.69%	27906	5892
中证800	4583.88	5035.08	4347.47	4710.78	127.25	2.78%	89011	15770
中证200	4846.68	5349.62	4555.73	5078.52	233.42	4.82%	20660	3975
中证500	4653.54	5184.15	4308.52	5057.62	394.20	8.45%	39274	5651
中证700	4756.10	5265.59	4440.33	5067.99	308.13	6.47%	59934	9626
300成长	4811.31	5245.41	4492.83	4807.30	0.30	0.01%	15867	4370
300价值	4791.75	5296.34	4569.62	4854.83	70.04	1.46%	24775	4307
上证指数	4388.25	4695.80	4123.31	4348.54	-34.85	-0.80%	86117	14228
上证180	10227.96	11137.80	9683.83	10289.48	71.53	0.70%	39264	7191
上证50	3502.23	3817.61	3275.84	3470.60	-27.32	-0.78%	24099	4524
红利指数	3983.63	4447.79	3779.12	4126.50	140.36	3.52%	9238	1512
深证成指	15837.88	17476.85	14907.27	15823.88	-33.83	-0.21%	6216	1720

股票指数阶段收益情况

	2月	1月	近3个月	近半年	近1年	年初至今
沪深300	1.17%	-13.45%	-1.33%	-11.75%	83.71%	-12.43%
中证100	-0.69%	-16.03%	-7.70%	-14.74%	74.96%	-16.61%
中证800	2.78%	-11.95%	3.25%	-8.90%	86.95%	-9.51%
中证200	4.82%	-7.17%	14.46%	-4.37%	103.15%	-2.70%
中证500	8.45%	-5.74%	22.67%	3.27%	101.22%	2.22%
中证700	6.47%	-6.53%	18.15%	-0.94%	102.08%	-0.48%
上证指数	-0.80%	-16.69%	-10.74%	-16.68%	50.93%	-17.35%
上证180	0.70%	-15.02%	-4.32%	-12.99%	76.55%	-14.43%
上证50	-0.78%	-17.24%	-10.56%	-16.37%	65.56%	-17.89%
红利指数	3.52%	-14.48%	1.39%	-9.14%	77.90%	-11.47%

股票指数阶段波动情况

	2月	1月	近3个月	近半年	近1年	年初至今
沪深300	44.88%	44.15%	39.85%	35.75%	36.04%	44.53%
中证100	46.56%	43.31%	40.49%	36.31%	35.62%	44.95%
中证800	44.41%	45.18%	39.67%	35.51%	36.65%	44.78%
中证200	44.39%	48.28%	40.70%	37.05%	39.34%	46.15%
中证500	46.64%	52.22%	42.02%	38.24%	41.60%	49.07%
中证700	45.15%	49.87%	41.06%	37.24%	40.08%	47.26%
上证指数	44.16%	40.45%	37.94%	35.34%	34.58%	42.44%
上证180	45.56%	43.60%	40.03%	36.08%	35.84%	44.58%
上证50	47.29%	43.30%	40.77%	36.86%	35.58%	45.36%
上证红利	44.49%	48.68%	42.84%	41.07%	40.86%	47.42%

中证债券指数表现

	1月收盘	2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	112.68	114.57	1.89	1.68%	1759.89	6.58	6.30	68.38	4.30
中证3债	115.43	115.94	0.51	0.44%	973.26	1.80	1.73	4.98	3.82
中证7债	113.45	114.21	0.76	0.67%	537.62	4.36	4.19	23.37	4.25
中证10债	110.27	110.95	0.68	0.62%	167.84	7.64	7.30	67.23	4.70
中证10+债	105.70	110.50	4.80	4.54%	81.18	11.32	10.85	158.46	4.38
中证国债	112.20	114.30	2.10	1.87%	380.55	6.99	6.71	74.84	4.09
中证金融债	114.67	115.70	1.03	0.90%	1146.58	5.22	4.99	49.09	4.44
中证企业债	113.30	116.44	3.14	2.77%	232.76	7.83	7.42	80.43	5.60

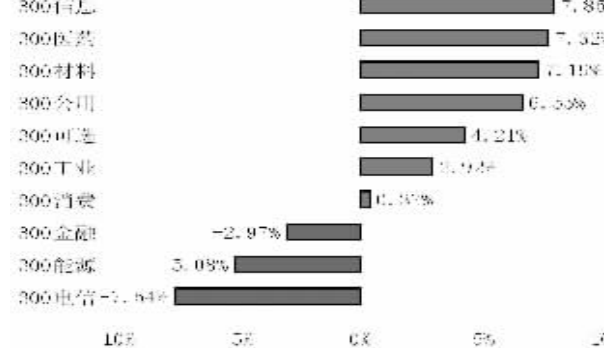
行业指数表现

	沪深300	中证800	上证指数	上证180
能源	-5.08%	-3.34%	-7.51%	-6.38%
原材料	7.19%	8.44%	7.73%	6.48%
工业	2.92%	4.89%	3.45%	4.46%
可选消费	4.21%	5.83%	5.81%	2.82%
主要消费	0.37%	4.33%	6.52%	0.09%
医药卫生	7.62%	10.25%	9.15%	14.15%
金融地产	-2.97%	-1.95%	-0.36%	-1.05%
信息技术	7.85%	9.75%	8.17%	8.91%
电信业务	-7.54%	-3.77%	-4.63%	-7.81%
公用事业	6.55%	7.86%	6.38%	6.64%

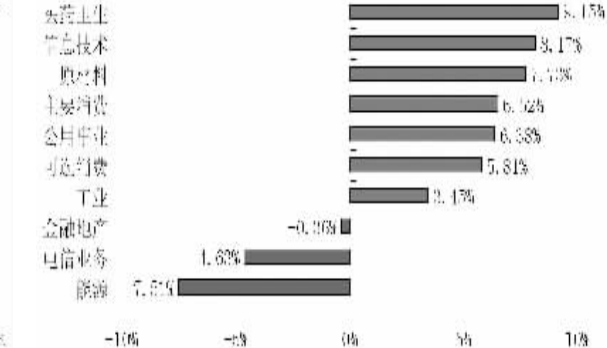
行业对指数贡献度

	沪深300	中证800	上证指数	上证180
能源	-35.90%	-7.43%	-4456.63%	-52.43%
原材料	101.72%	46.63%	1719.84%	69.06%
工业	35.17%	23.51%	999.53%	47.30%
可选消费	26.23%	16.70%	585.67%	13.22%
主要消费	1.42%	6.96%	380.81%	0.26%
医药卫生	7.08%	8.05%	295.92%	15.63%
金融地产	-61.17%	-12.62%	-230.57%	-25.25%
信息技术	10.02%	8.26%	210.37%	12.07%
电信业务	-12.21%	-2.51%	-123.68%	-14.00%
公用事业	27.63%	12.26%	518.74%	34.14%

沪深300行业指数月度表现



中证指数行业月度表现

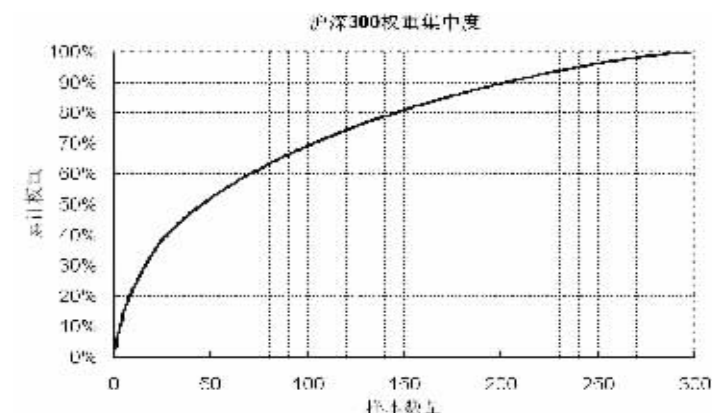
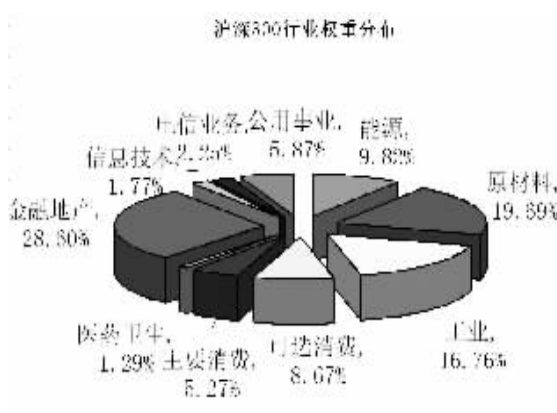
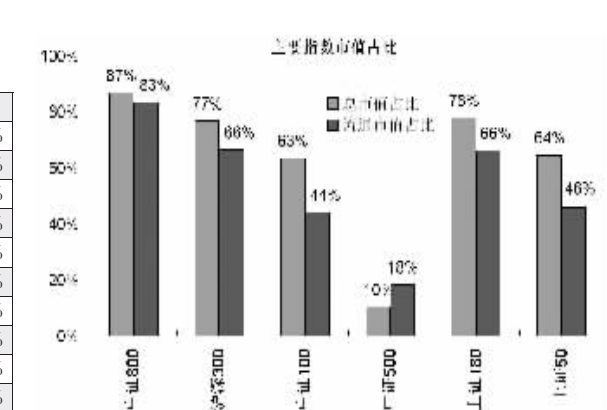


沪深300行业估值

	P/E	P/B	EPS	ROE	ROA
沪深300	29.81	4.88	0.56	16.38%	3.33%
能源	25.92	5.93	0.90	22.89%	18.42%
原材料	27.26	5.04	0.82	18.50%	10.67%
工业	43.34	6.15	0.46	14.19%	7.52%
可选消费	41.75	4.91	0.50	11.76%	6.44%
主要消费	70.76	10.77	0.54	15.23%	11.80%
医药卫生	51.29	6.77	0.46	13.19%	9.09%
金融地产	28.34	4.01	0.40	14.13%	1.42%
信息技术	55.57	5.79	0.32	10.42%	6.44%
电信业务	38.56	2.74	0.33	7.10%	6.82%
公用事业	28.35	3.30	0.50	11.64%	6.54%

行业权重占比

	沪深300	中证800	上证指数	上证180
能源	9.82%	8.15%	28.53%	11.68%
原材料	19.69%	20.23%	10.70%	15.15%
工业	16.76%	17.60%	13.92%	15.09%
可选消费	8.67%	10.49%	4.85%	6.67%
主要消费	5.27%	5.88%	2.81%	4.01%
医药卫生	1.29%	2.88%	1.55%	1.57%
金融地产	28.60%	23.72%	30.78%	34.05%
信息技术	1.77%	3.10%	1.24%	1.93%
电信业务	2.25%	2.25%	1.28%	2.55%
公用事业	5.87%	5.71%	3.91%	7.31%



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
中信证券	62.86	-7.72%	中信证券	62.86	-7.72%	中国石化	22.57	-12.74%	中信证券	62.86	-7.72%
中国神华	50.40	-10.73%	中国神华	50.40	-10.73%	工商银行	6.53	-3.68%	中国神华	50.40	-10.73%
招商银行	31.97	-1.69%	招商银行	31.97	-1.69%	中国石化	17.01	-5.96%	招商银行	31.97	-1.69%
浦发银行	42.13	-8.41%	浦发银行	42.13	-8.41%	中国银行	5.55	0.37%	浦发银行	42.13	-8.41%
万科A	23.25	-10.75%	万科A	23.25	-10.75%	中国神华	50.40	-15.00%	民生银行	13.71	14.25%
民生银行	13.71	14.25%	民生银行	13.71	14.25%	中国人寿	39.05	-7.74%	宝钢股份	17.12	10.31%
宝钢股份	17.12	10.31%	宝钢股份	17.12	10.31%	招商银行	31.97	-4.37%	中国联通	10.51	-8.69%
中国联通	10.51	-8.69%	中国联通	10.51	-8.69%	中国平安	71.20	-6.56%	工商银行	6.53	0.00%
工商银行	6.53	0.00%	工商银行	6.53	0.00%	中国铝业	32.00	0.99%	贵州茅台	195.00	-5.35%
贵州茅台	195.00	-5.35%	贵州茅台	195.00	-5.35%	交通银行	11.77	-8.15%	建设银行	7.91	0.00%

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
承德钒钛	20.04	31.50%	沧州大化	34.98	61.20%	ST北生	11.55	84.96%	浙江医药	23.46	46.72%
航天机电	14.01	28.30%	丰乐种业	17.33	59.87%	通威股份	25.31	67.34%	海正药业	23.69	31.90%
陆家嘴	27.31	27.50%	龙头股份	14.40	54.34%	科大创新	18.34	61.12%	承德钒钛	20.04	31.50%
新安股份	86.97	26.04%	南宁糖业	25.72	49.53%	华侨股份	10.64	61.34%	航天机电	14.01	28.30%
南玻A	22.85	25.27%	同济科技	13.68	47.10%	龙头股份	14.40	60.56%	陆家嘴	27.31	27.50%
浙大网新	13.97	25.07%	浙江医药	23.46	46.72%	钱江生化	10.24	58.77%	浙大网新	13.97	25.07%
天威保变	57.03	23.76%	厦门港务	17.30	44.17%	同济科技	13.68	58.60%	天威保变	57.03	23.76%
重庆啤酒	30.78	23.61%	迪马股份	25.05	39.24%	禾嘉股份	10.45	57.81%	江苏阳光	11.20	23.21%
西宁特钢	21.66	23.56%	博润科技	26.93	38.10%	沧州大化	34.98	53.46%	国电电力	18.55	21.24%
江苏阳光	11.20	23.21%	新农开发	17.16	37.72%	五洲交通	10.42	52.20%	辽宁成大	51.68	18.80%

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
株冶集团	21.09	-25.82%	株冶集团	21.09	-25.82%	*ST金泰	14.31	-28.59%	株冶集团	21.09	-25.82%
中国船舶	182.86	-15.67%	万业企业	21.08	-17.59%	株冶集团	21.09	-27.61%	万业企业	21.08	-17.59%
双汇发展	47.80	-13.80%	新湖创业	16.19	-17.14%	天鸿宝业	34.39	-25.88%	国阳新能	47.01	-12.77%
国阳新能	47.01	-12.77%	中国船舶	182.86	-15.67%	*ST华源B	0.35	-23.37%	国金证券	45.59	-12.55%
国金证券	45.59	-12.55%	东方铝业	18.97	-14.28%	*ST宜纸	9.20	-23.51%	华夏银行	17.12	-11.75%
招商地产	51.72	-12.43%	天鸿宝业	34.39	-13.92%	万业企业	21.08	-22.52%	北京城建	22.25	-10.89%
华夏银行	17.12	-11.75%	双汇发展	47.80	-13.80%	*ST华源	6.15	-21.76%	中国神华	50.40	-10.73%
北京城建	22.25	-10.89%	国阳新能	47.01	-12.77%	康美药业	17.08	-21.48%	中国石化	22.57	-10.68%
万科A	23.25	-10.75%	国金证券	45.59	-12.55%	华夏银行	17.12	-19.07%	大商股份	48.37	-10.46%
中国神华	50.40	-10.73%	乐凯胶片	13.52	-12.49%	国阳新能	47.01	-18.72%	广船国际	54.44	-9.22%

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	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
民生银行	13.71	14.25%	民生银行	13.71	14.25%	中国石化	22.57	-12.66%	民生银行	13.71	14.25%
宝钢股份	17.12	10.31%	宝钢股份	17.12	10.31%	中国神华	50.40	-14.63%	宝钢股份	17.12	10.31%
鞍钢股份	25.98	16.19%	鞍钢股份	25.98	16.19%	中国石化	17.01	-5.96%	国电电力	18.55	21.24%
国电电力	18.55	21.24%	国电电力	18.55	21.24%	中国人寿	39.05	-7.92%	辽宁成大	51.68	18.80%
辽宁成大	51.68	18.80%	辽宁成大	51.68	18.80%	工商银行	6.53	-3.83%	武钢股份	20.32	9.01%
武钢股份	20.32	9.01%	武钢股份	20.32	9.01%	大秦铁路	19.73	-12.98%			