

上证指数季报

2016年04-06月



 上海證券交易所
SHANGHAI STOCK EXCHANGE

 中证指数有限公司
CHINA SECURITIES INDEX CO., LTD

编

目录

本季度情况介绍	1
上证指数季度走势图（2016.04-2016.06）	2
指数基本资料	3
一、上证指数收益率和波动率	3
二、上证指数市盈率	3
三、上证指数市净率	3
四、上证指数股息率	3
五、上证指数市场基本指标	4
六、上证指数财务基本指标	4
指数行业分布比较	4
一、上证 50 指数行业分布	4
二、上证 180 指数行业分布	5
三、上证 380 指数行业分布	5
四、上证综合指数行业分布	6
样本股表现	6
一、本季度十大涨跌成分股	6
二、本季度十大成交成分股	7
三、季度末十大权重成分股	9
四、季度末样本分布	10
上证系列指数概况	11
一、上证系列指数季度表现	11
指数衍生品	13
指标定义	14

本季度情况介绍

指数收盘（2016年6月30日）和二季度涨跌幅

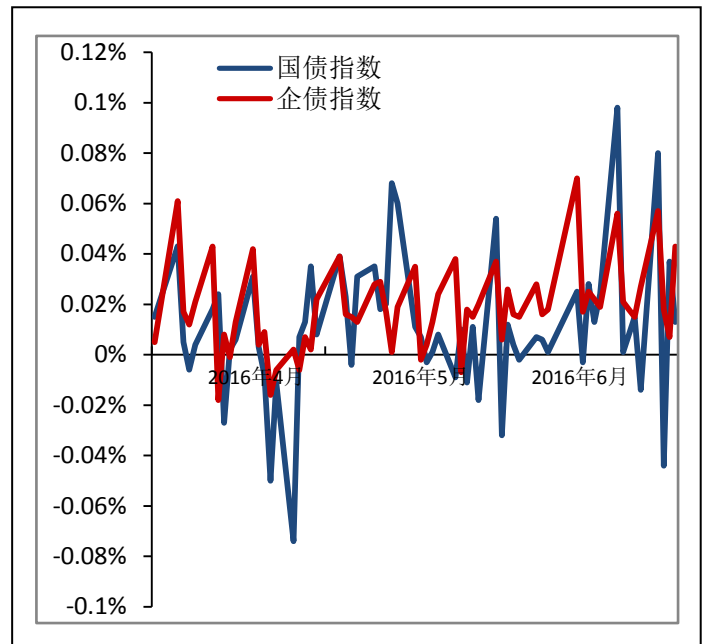
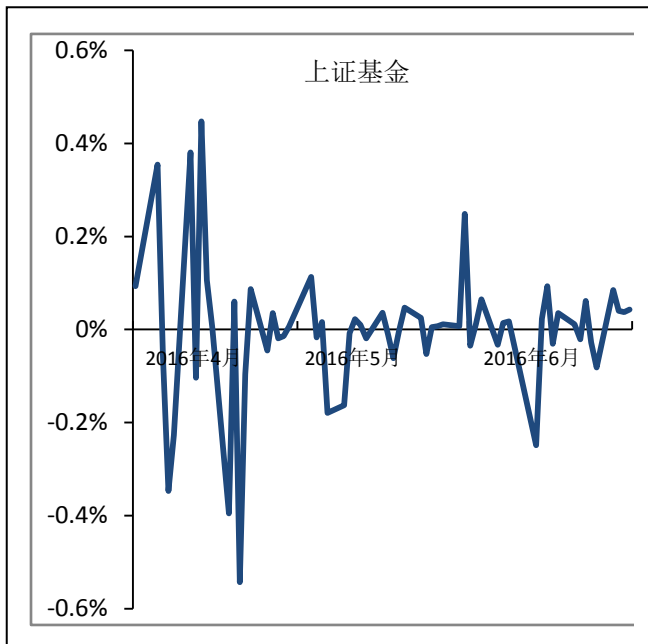
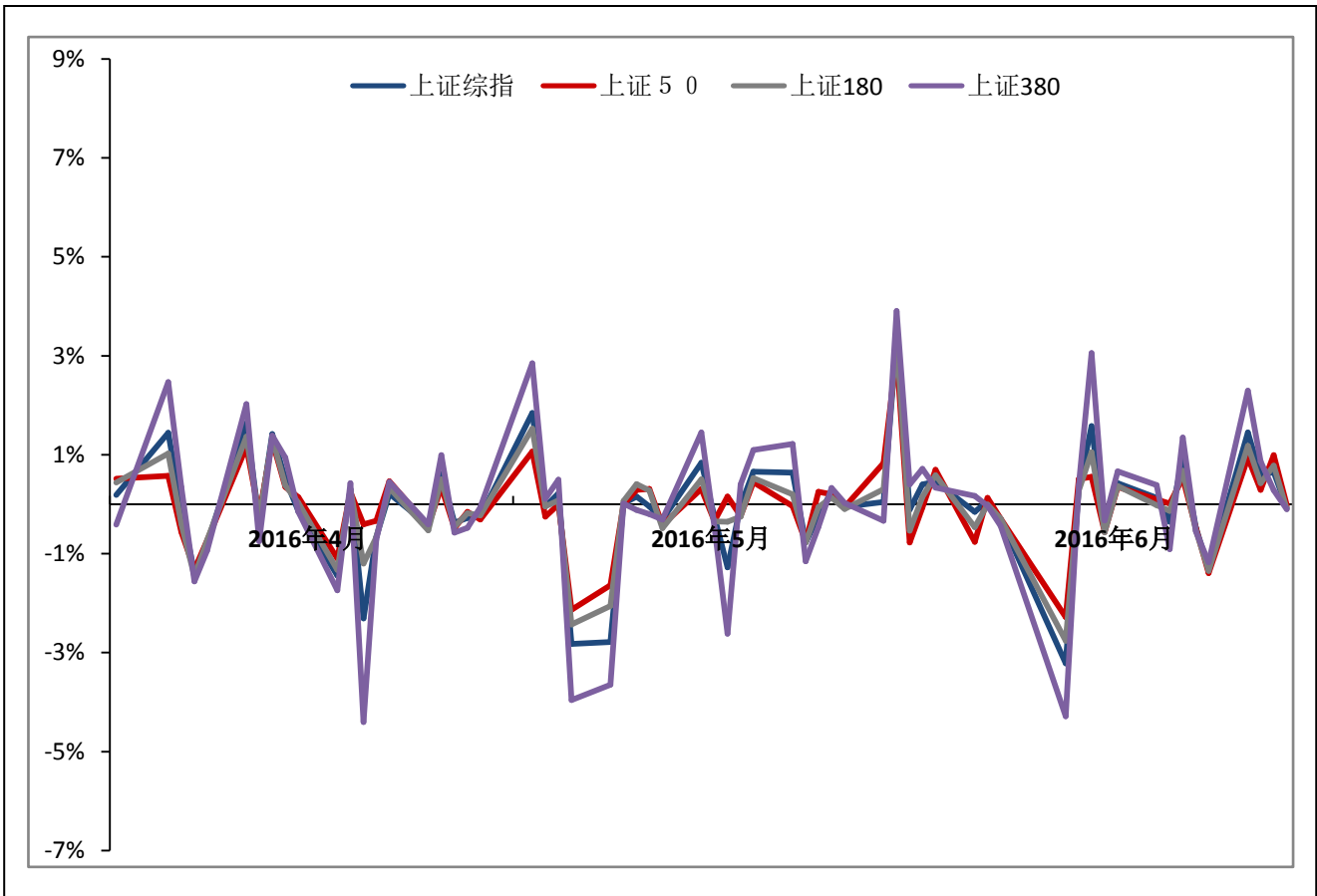
上证 180 指数	6735.89	-2.69%	上证企债指数	203.69	1.14%
上证 50 指数	2122.63	-1.57%	上证国债指数	157.67	0.67%
上证 380 指数	5310.99	-2.05%	上证基金指数	5644.23	-0.20%
上证综指指数	2929.61	-2.47%			

本季度 180 指数与上证综指的日收益率相关系数为 97%，显示了较强的市场代表性。6 月 30 日，上证 180 指数成份股的流通市值占上海 A 股市场的 69%，总市值占 64%，覆盖了市场的主体部分。同期，上证 380 和上证 180 指数的日收益率相关系数为 89.56%，流通市值占上海 A 股市场的 18%，总市值占上海 A 股市场的 21%，覆盖了剩余市场的大部分。

上证 180 指数、上证 50 指数和上证 380 指数的每股收益分别为 0.63 元、0.7 元和 0.3 元。6 月末上证 180 指数、上证 50 指数和上证 380 指数的市盈率分别为 11.15 倍、9.48 倍和 32.76 倍，而上年同期上证 180 指数、上证 50 指数和上证 380 指数的市盈率则分别为 15.56 倍、12.49 倍和 48.35 倍。

本季度上证消费指数涨幅 3.979%，在沪市 A 股指数体系中涨幅居前。本季度上证工业指数跌幅-9.695%，在沪市 A 股指数体系中跌幅居前。

上证指数季度走势 (2016.04-2016.06)

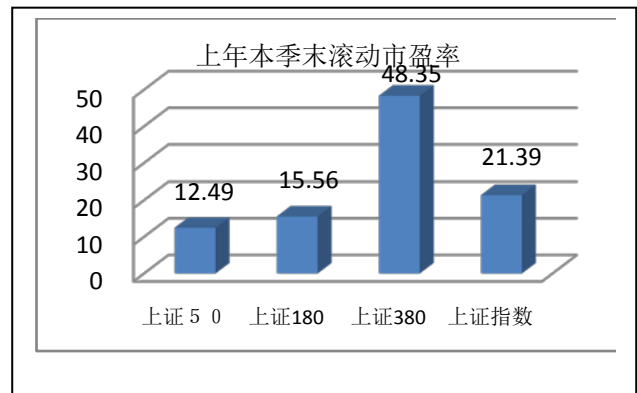
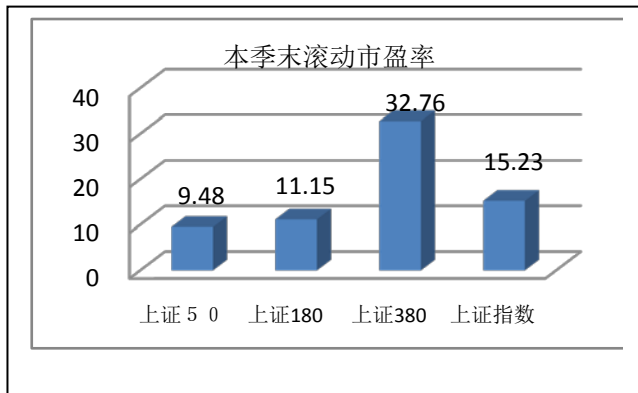


指数基本资料

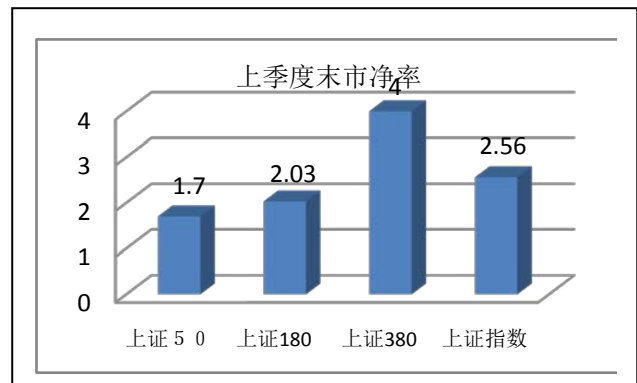
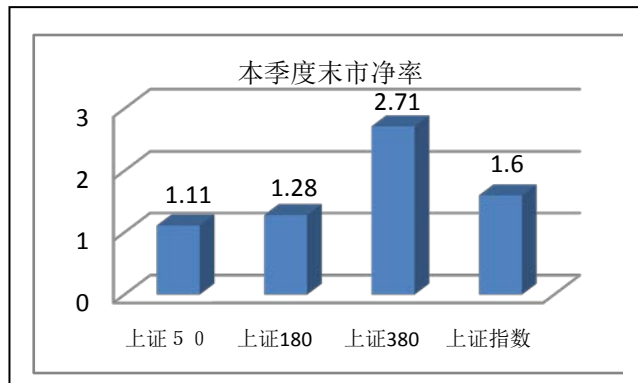
一、上证指数收益率和波动率

	累计收益%					日收益标准差%				
	4月	5月	6月	季度	上年本季	4月	5月	6月	季度	上年本季
上证50	-0.98	0.94	-1.53	-1.57	4.19	0.66	0.97	0.78	0.82	2.62
上证180	-1.77	0.36	-1.29	-2.69	8.37	0.79	1.11	0.86	0.93	2.59
上证380	-3.27	-1.65	2.95	-2.05	24.63	1.45	1.78	1.41	1.56	2.97
上证指数	-2.18	-0.74	0.45	-2.47	14.12	0.96	1.28	0.99	1.09	2.56

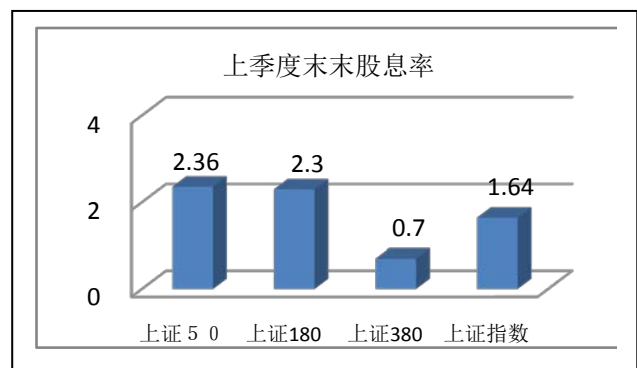
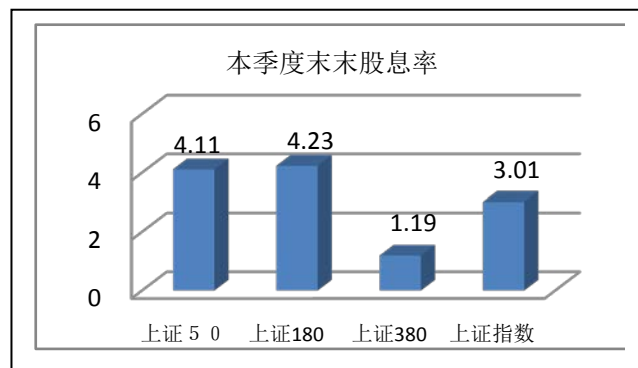
二、上证指数市盈率



三、上证指数市净率



四、上证指数股息率



五、上证指数市场基本指标

	上证 50	上证 180	上证 380	上证综指
指数总市值 (万亿元)	11.08	16.02	5.13	25.09
指数总市值覆盖率%	44.00	64.00	21.00	100.00
指数流通市值 (万亿元)	10.71	14.88	4.01	21.79
指数流通市值覆盖率%	49.00	69.00	18.00	100.00
样本股日均成交额 (亿元)	4.20	3.33	1.53	1.60
换手率%	7.91	17.31	77.91	35.33
指数日收益相关系数	97.11	100.00	89.56	97.00

六、上证指数财务基本指标

	上证 50	上证 180	上证 380	上证综指
税后利润 (亿元)	11599.34	14134.24	1459.83	15284.92
股东权益 (亿元)	99849.48	125386.03	18929.35	155869.37
每股收益 (元)	0.70	0.63	0.30	0.49
每股净资产 (元)	6.02	5.60	3.94	4.98
净资产收益率%	11.62	11.27	7.71	9.81
股东权益比率%	10.34	11.62	37.60	13.37
资产负债比率%	89.66	88.38	62.40	86.63
资产报酬率%	1.20	1.31	2.90	1.31

指数行业分布比较

一、上证 50 指数行业分布

中证一级行业	股票数目	占行业比例%	自由流通市值 (亿元)	占行业比例%	指数权重%
能源	3	6.98	18537.58	80.89	17.30
原材料	2	1.09	933.78	5.29	0.87
工业	12	4.26	11887.22	30.25	11.10
可选消费	2	1.05	2625.86	13.41	2.45
主要消费	3	3.66	5340.82	46.09	4.99
金融地产	25	22.94	66125.37	83.41	61.73
电信业务	1	7.14	807.59	34.03	0.75
公用事业	2	3.64	865.43	10.39	0.81

二、上证 180 指数行业分布

中证一级行业	股票数目	占行业比例%	自由流通市值(亿元)	占行业比例%	指数权重%
能源	7	16.28	19,649.11	85.74	13.21
原材料	17	9.29	6,520.19	36.92	4.38
工业	39	13.83	21,402.33	54.46	14.39
可选消费	20	10.47	7,437.45	37.99	5.00
主要消费	11	13.41	7,016.11	60.55	4.72
医药卫生	8	12.50	2,771.65	37.71	1.86
金融地产	59	54.13	75,926.33	95.77	51.04
信息技术	8	10.96	2,585.61	30.28	1.74
电信业务	2	14.29	1,098.64	46.29	0.74
公用事业	9	16.36	4,349.65	52.24	2.92

三、上证 380 指数行业分布

中证二级行业	股票数目	占行业比例%	自由流通市值(亿元)	占行业比例%	指数权重%
能源	14	32.56	1,916.03	8.36	4.78
原材料	56	30.60	5,587.79	31.64	13.93
资本品	80	40.00	7,929.99	29.35	19.76
商业服务与商业用品	10	38.46	704.47	40.59	1.76
运输	25	44.64	3,085.80	29.26	7.69
汽车与汽车零部件	17	36.17	2,715.91	34.75	6.77
耐用消费品与服装	16	25.40	1,197.76	25.07	2.99
消费者服务	5	26.32	454.59	32.14	1.13
媒体	7	30.43	1,135.58	38.11	2.83
零售业	17	43.59	1,534.05	59.22	3.82
食品与主要用品零售	5	29.41	374.46	15.45	0.93
食品、饮料与烟草	20	32.79	1,778.07	20.13	4.43
家庭与个人用品	1	25.00	53.49	16.15	0.13
医疗保健设备与服务	2	33.33	186.43	55.18	0.46
制药、生物科技和生	28	48.28	3,103.62	44.26	7.74
房地产	17	24.29	1,506.87	16.53	3.76
软件与服务	9	36.00	1,129.80	35.12	2.82
技术硬件与设备	15	42.86	1,546.77	41.36	3.86
半导体产品与设备	8	61.54	1,042.19	65.88	2.60
通信设备	5	38.46	648.07	41.39	1.62
公用事业	23	41.82	2,491.41	29.92	6.21

四、上证综合指数行业分布

中证一级行业	股票数目	总市值（亿元）	自由流通市值
能源	44	24,814.49	22,981.78
原材料	192	21,308.48	17,796.95
工业	297	45,950.89	39,608.58
可选消费	202	25,152.83	19,760.26
主要消费	84	14,237.11	11,612.06
医药卫生	66	8,756.39	7,380.87
金融地产	115	84,510.79	79,455.84
信息技术	75	10,898.64	8,583.32
电信业务	16	2,704.39	2,403.00
公用事业	57	12,586.44	8,349.52

样本股表现

一、本季度十大涨跌成分股

上证 180 指数

代码	简称	涨幅%	代码	简称	跌幅%
600547	山东黄金	48.42	600873	梅花生物	-30.97
600639	浦东金桥	37.40	600153	建发股份	-30.12
600094	大名城	26.16	601018	宁波港	-27.30
600519	贵州茅台	17.88	601727	上海电气	-19.83
600887	伊利股份	17.86	601718	际华集团	-18.72
600100	同方股份	16.78	600415	小商品城	-18.56
603993	洛阳钼业	15.92	600352	浙江龙盛	-17.39
600570	恒生电子	14.97	600606	绿地控股	-16.85
600489	中金黄金	11.93	600895	张江高科	-16.70
600029	南方航空	11.89	601919	中国远洋	-16.58

上证 50 指数

代码	简称	涨幅%	代码	简称	跌幅%
600519	贵州茅台	17.88	601727	上海电气	-19.83
600887	伊利股份	17.86	601919	中国远洋	-16.58
600029	南方航空	11.89	600958	东方证券	-15.52
601688	华泰证券	10.58	600637	东方明珠	-15.29
600036	招商银行	8.76	601377	兴业证券	-14.83
600837	海通证券	7.91	601390	中国中铁	-13.42
600111	北方稀土	5.20	600893	中航动力	-12.26
601398	工商银行	3.50	601800	XD 中国交	-12.16
601601	中国太保	3.09	601989	中国重工	-11.96
601169	北京银行	2.88	600050	XD 中国联	-11.84

上证380指数

代码	简称	涨幅%	代码	简称	跌幅%
600459	贵研铂业	68.75	600116	三峡水利	-32.25
600549	厦门钨业	56.57	600122	宏图高科	-30.96
603306	华懋科技	55.03	600297	广汇汽车	-30.15
600260	凯乐科技	47.12	600801	华新水泥	-29.35
600667	太极实业	43.06	600673	东阳光科	-26.66
603806	福斯特	38.29	601717	郑煤机	-24.07
603866	桃李面包	38.10	600871	石化油服	-23.35
600563	法拉电子	34.58	600662	强生控股	-23.07
603368	柳州医药	34.57	600017	日照港	-22.41
600007	中国国贸	34.55	600650	锦江投资	-20.77

上证综指

代码	简称	涨幅%	代码	简称	跌幅%
603528	多伦科技	936.93	601918	*ST 新集	-42.01
603779	威龙股份	810.20	600806	*ST 昆机	-38.51
603737	三棵树	628.23	600234	*ST 山水	-34.68
603959	百利科技	587.40	600247	ST 成城	-32.65
603131	上海沪工	501.59	600116	三峡水利	-32.25
603701	德宏股份	486.81	600873	梅花生物	-30.97
603822	嘉澳环保	448.72	600122	宏图高科	-30.96
603339	四方冷链	434.05	600297	广汇汽车	-30.15
603029	天鹅股份	399.78	600153	建发股份	-30.12
603028	赛福天	379.77	600801	华新水泥	-29.35

二、本季度十大成交成分股

上证180指数

代码	简称	成交金额 (亿元)	代码	简称	成交股数 (亿股)
600570	恒生电子	1528.34	600839	四川长虹	91.02
600030	中信证券	912.95	601899	紫金矿业	75.52
600446	金证股份	873.29	600010	包钢股份	63.80
600547	山东黄金	769.61	600028	中国石化	60.05
600111	北方稀土	711.17	600221	海南航空	58.26
601198	东兴证券	695.86	601988	中国银行	57.16
601318	中国平安	691.58	601939	XD 建设银	55.97
600100	同方股份	673.95	600030	中信证券	54.90
600519	贵州茅台	463.52	603993	洛阳钼业	52.79
601166	兴业银行	435.37	600111	北方稀土	52.26

上证 50 指数

代码	简称	成交金额 (亿元)	代码	简称	成交股数 (亿股)
600030	中信证券	912.95	600010	包钢股份	63.80
600111	北方稀土	711.17	600028	中国石化	60.05
601318	中国平安	691.58	601988	中国银行	57.16
600519	贵州茅台	463.52	600030	中信证券	54.90
601166	兴业银行	435.37	600111	北方稀土	52.26
600837	海通证券	434.45	601288	农业银行	50.52
600016	民生银行	426.44	600029	南方航空	49.64
600958	东方证券	407.30	601377	兴业证券	49.33
601788	光大证券	406.69	600016	民生银行	47.49
601377	兴业证券	395.23	601668	中国建筑	45.88

上证 380 指数

代码	简称	成交金额 (亿元)	代码	简称	成交股数 (亿股)
600366	宁波韵升	486.35	600871	石化油服	39.53
600988	赤峰黄金	469.22	601880	大连港	31.09
600549	厦门钨业	449.00	600460	士兰微	30.53
600699	均胜电子	439.62	600116	三峡水利	30.48
600884	杉杉股份	401.71	601636	旗滨集团	27.09
600718	东软集团	387.00	600166	福田汽车	26.76
600116	三峡水利	356.92	600255	鑫科材料	26.52
600756	浪潮软件	351.49	600206	有研新材	26.33
600206	有研新材	311.72	600210	紫江企业	26.13
600522	中天科技	279.65	600988	赤峰黄金	25.69

上证综指

代码	简称	成交金额 (亿元)	代码	简称	成交股数 (亿股)
600570	恒生电子	1528.34	600839	四川长虹	91.02
600030	中信证券	912.95	601899	紫金矿业	75.52
600446	金证股份	873.29	600010	包钢股份	63.80
600547	山东黄金	769.61	600401	海润光伏	63.76
600392	盛和资源	713.95	600028	中国石化	60.05
600111	北方稀土	711.17	600221	海南航空	58.26
601198	东兴证券	695.86	601988	中国银行	57.16
601318	中国平安	691.58	601939	XD 建设银	55.97
600100	同方股份	673.95	600030	中信证券	54.90
600366	宁波韵升	486.35	603993	洛阳钼业	52.79

三、季度末十大权重成分股

上证 180 指数、上证 50 指数

代码	简称	调整市值 (亿元)	中证一级 行业	占上证 50 行业比例%	占上证 50 权重%	占上证 180 行 业比例%	占上证 180 权重%
601398	工商银行	11,970.78	金融地产	17.90	11.05	15.49	7.89
601857	中国石油	11,706.97	能源	63.15	10.81	59.32	7.72
601288	农业银行	9,409.77	金融地产	14.07	8.69	12.18	6.20
601988	中国银行	6,765.57	金融地产	10.12	6.25	8.76	4.46
600028	中国石化	4,510.33	能源	24.33	4.16	22.86	2.97
601628	中国人寿	4,335.46	金融地产	6.48	4.00	5.61	2.86
600519	贵州茅台	3,667.09	主要消费	68.56	3.39	51.66	2.42
600036	招商银行	3,610.07	金融地产	5.40	3.33	4.67	2.38
601318	中国平安	3,470.79	金融地产	5.19	3.20	4.49	2.29
600000	浦发银行	3,365.97	金融地产	5.03	3.11	4.36	2.22

上证 380 指数

代码	简称	调整市值 (亿元)	中证二级行业	占上证 380 行业比例%	占上证 380 权重%
601238	广汽集团	991.68	汽车与汽车零部件	35.22	2.37
600309	万华化学	374.08	原材料	6.31	0.90
601808	中海油服	359.70	能源	18.37	0.86
601098	中南传媒	325.26	媒体	28.06	0.78
600188	XD 兖州煤	323.82	能源	16.54	0.77
600549	厦门钨业	321.34	原材料	5.42	0.77
600377	宁沪高速	318.23	运输	10.18	0.76
601158	重庆水务	308.64	公用事业	12.02	0.74
600373	中文传媒	285.92	媒体	24.66	0.68
600867	通化东宝	282.00	制药、生物科技和生命科学	8.69	0.67

上证综指

代码	简称	总市值 (亿元)	自由流通市值 (亿元)	中证一级行业
601398	工商银行	11,970.78	11,970.78	金融地产
601857	中国石油	11,706.97	11,706.97	能源
601288	农业银行	9,409.77	9,409.77	金融地产
601988	中国银行	6,765.57	6,765.57	金融地产
600028	中国石化	4,510.33	4,510.33	能源
601628	中国人寿	4,335.46	4,335.46	金融地产
600519	贵州茅台	3,667.09	3,667.09	主要消费
600036	招商银行	3,610.07	3,610.07	金融地产
601318	中国平安	3,470.79	3,470.79	金融地产
600000	浦发银行	3,365.97	3,194.78	金融地产

四、季度末样本分布

上证 180 指数	股票数目	占市场比例%	自由流通市值 (亿元)	占市场比例 (%)
规模分布				
50~100 亿元	1	0.27	98.32	0.37
100~500 亿	106	25.85	30550.08	37.63
500~1000 亿	37	88.10	24799.33	87.98
1000~5000 亿	32	100.00	64884.04	100.00
5000 亿元以上	4	100.00	39853.09	100.00

上证 50 指数	股票数目	占市场比例%	自由流通市值 (亿元)	占市场比例 (%)
规模分布				
100~500 亿	5	1.22	2269.82	2.80
500~1000 亿	13	30.95	10136.33	35.96
1000~5000 亿	28	87.50	58580.99	90.29
5000 亿元以上	4	100.00	39853.09	100.00

上证 380 指数	股票数目	占市场比例%	自由流通市值 (亿元)	占市场比例 (%)
规模分布				
30~50 亿	14	6.86	646.39	7.85
50~100 亿	145	38.87	10995.54	41.14
100~200 亿	162	61.13	22320.37	60.30
200~500 亿	56	38.62	15017.88	34.00
500 亿元以上	3	3.85	2322.06	1.75

上证综指	股票数目	总市值 (亿元)	自由流通市值 (亿元)
规模分布			
30 亿元以下	77	1528.75	1501.88
30~50 亿	207	8350.30	7339.81
50~100 亿	376	26934.53	21975.24
100~200 亿	265	37018.37	28404.56
200~500 亿	145	44163.81	36037.66
500 亿元以上	78	132924.68	122673.03

上证系列指数概况

一、上证系列指数季度表现

代码	简称	最高 (日期)	最低 (日期)	收盘 (2016.06.30)	季度涨跌%		
上证 180 系列							
000010	上证 180	7090.74	2016-04-13	6499.19	2016-06-24	6735.89	-2.69
000016	上证 50	2197.74	2016-04-13	2052.98	2016-06-24	2122.63	-1.57
000018	180 金融	4483.27	2016-04-13	4213.93	2016-05-12	4349.20	-1.06
000021	180 治理	820.16	2016-04-13	751.63	2016-06-24	774.32	-3.17
000025	180 基建	1705.20	2016-04-05	1478.34	2016-06-24	1529.24	-8.15
000026	180 资源	2338.03	2016-04-13	2050.90	2016-05-12	2217.56	2.14
000027	180 运输	960.26	2016-04-05	847.32	2016-06-24	873.75	-6.36
000043	超大盘	1914.80	2016-04-13	1767.15	2016-06-24	1836.12	-1.75
000044	上证中盘	3303.81	2016-04-13	2931.66	2016-06-24	3052.51	-4.49
000050	50 等权	2209.43	2016-04-13	1997.29	2016-06-24	2073.89	-3.89
000054	上证海外	1046.30	2016-04-13	977.80	2016-06-24	1005.14	-1.78
上证 180 风格指数							
000028	180 成长	2602.06	2016-04-13	2427.22	2016-06-24	2517.61	-1.33
000029	180 价值	3251.67	2016-04-13	3057.05	2016-06-24	3133.06	-1.59
000030	180R 成长	1749.07	2016-04-13	1579.98	2016-05-26	1657.20	-3.00
000031	180R 价值	2571.85	2016-04-13	2381.42	2016-06-24	2447.83	-2.43
上证规模指数							
000009	上证 380	5625.78	2016-04-13	4853.87	2016-05-18	5310.99	-2.05
000045	上证小盘	4772.55	2016-04-13	4102.32	2016-05-18	4481.38	-2.34
000046	上证中小	3960.60	2016-04-13	3471.02	2016-05-26	3688.93	-3.43
000047	上证全指	2945.03	2016-04-13	2664.88	2016-05-26	2790.39	-2.57
上证全指风格指数							
000057	全指成长	3036.01	2016-04-13	2820.60	2016-05-12	2944.64	-1.05
000058	全指价值	3260.55	2016-04-13	3033.74	2016-06-24	3129.33	-1.85
000059	全 R 成长	2665.49	2016-04-13	2371.37	2016-05-12	2533.07	-2.31
000060	全 R 价值	3158.01	2016-04-13	2882.64	2016-06-24	2985.18	-2.77
上证行业指数							
000032	上证能源	1584.26	2016-04-13	1337.68	2016-06-15	1408.54	-3.55
000033	上证材料	1805.63	2016-04-13	1515.88	2016-05-12	1644.62	-1.98
000034	上证工业	2241.31	2016-04-05	1886.58	2016-06-24	1974.30	-9.70
000035	上证可选	2781.70	2016-04-13	2480.78	2016-06-24	2596.84	-3.65
000036	上证消费	5848.54	2016-06-03	5334.35	2016-04-20	5803.38	3.98
000037	上证医药	5721.32	2016-04-13	5158.64	2016-06-15	5477.81	-1.14
000038	上证金融	4241.84	2016-04-13	4005.61	2016-05-12	4125.79	-0.87
000039	上证信息	4306.73	2016-04-15	3575.37	2016-05-12	4104.57	-1.24
000040	上证电信	2736.71	2016-05-04	2388.79	2016-05-20	2696.68	3.89
000041	上证公用	2264.63	2016-04-13	2032.60	2016-06-24	2093.30	-5.96

代码	简称	最高 (日期)	最低 (日期)	收盘 (2015. 06. 30)	季度涨跌%		
上证行业策略指数							
000070	能源等权	2812.63	2016-04-13	2264.00	2016-06-15	2434.23	-4.46
000071	材料等权	2892.47	2016-04-13	2423.55	2016-05-12	2650.54	-1.63
000072	工业等权	2989.45	2016-04-05	2537.76	2016-06-24	2661.31	-8.52
000073	可选等权	3318.13	2016-04-13	2932.49	2016-05-18	3162.66	-1.01
000074	消费等权	5353.31	2016-06-03	4887.18	2016-04-25	5232.44	3.15
000075	医药等权	7964.57	2016-04-13	7130.98	2016-06-15	7605.77	-0.33
000076	金融等权	4478.80	2016-04-13	4159.25	2016-05-12	4314.79	-1.92
000077	信息等权	5617.19	2016-04-15	4695.75	2016-05-12	5503.37	2.17
000078	电信等权	2659.63	2016-04-15	2297.21	2016-05-20	2539.92	-0.86
000079	公用等权	2690.47	2016-04-13	2317.11	2016-06-24	2412.03	-7.34
上证央企、民企、国企主题指数							
000042	上证央企	1376.25	2016-04-13	1253.79	2016-06-24	1293.65	-4.03
000049	上证民企	1542.69	2016-04-13	1389.55	2016-05-26	1454.87	-3.73
000055	上证地企	1001.76	2016-04-13	934.02	2016-06-24	969.37	-0.54
000056	上证国企	909.31	2016-04-13	837.30	2016-06-24	866.10	-2.46
上证其他主题指数							
000015	红利指数	2497.83	2016-04-13	2270.42	2016-06-24	2333.41	-3.27
000048	责任指数	1158.45	2016-04-15	1066.80	2016-06-24	1101.93	-2.58
000062	上证沪企	2254.00	2016-04-13	2036.84	2016-06-24	2108.95	-3.87
000063	上证周期	2740.38	2016-04-13	2556.23	2016-05-12	2629.61	-1.58
000064	非周期	2382.71	2016-04-07	2115.85	2016-06-24	2220.45	-4.80
000065	上证龙头	2982.97	2016-04-13	2696.27	2016-05-26	2828.51	-2.80
000066	上证商品	1701.77	2016-04-13	1460.76	2016-05-12	1586.87	-0.09
000067	上证新兴	6835.25	2016-04-13	5949.01	2016-05-18	6396.44	-3.00
000068	上证资源	1933.53	2016-04-13	1668.07	2016-05-12	1828.00	2.23
000069	消费 80	3530.53	2016-04-13	3249.06	2016-05-26	3434.07	-0.40
上证综合类指数							
000001	上证指数	3097.17	2016-04-13	2780.76	2016-05-26	2929.61	-2.47
000002	A 股指数	3241.33	2016-04-13	2910.50	2016-05-12	3067.50	-2.45
000003	B 股指数	381.85	2016-04-13	330.72	2016-05-26	346.75	-7.57
000004	工业指数	2470.93	2016-04-13	2169.91	2016-05-18	2336.42	-1.36
000005	商业指数	4695.77	2016-04-15	3976.33	2016-05-26	4343.02	-4.11
000006	地产指数	5661.86	2016-04-15	5085.02	2016-05-26	5285.44	-3.71
000007	公用指数	5871.88	2016-04-05	5055.71	2016-06-24	5241.34	-8.77
000008	综合指数	2703.58	2016-04-13	2496.63	2016-05-12	2597.19	-2.16
000017	新综指	2613.83	2016-04-13	2347.00	2016-05-12	2472.75	-2.46
000020	中型综指	1590.95	2016-04-15	1358.82	2016-05-12	1515.28	-0.10
000090	上证流通	1125.18	2016-04-13	1008.28	2016-05-26	1068.28	-1.97
上证行业指数固定收益指数							
000012	国债指数	157.68	2016-06-28	156.54	2016-04-26	157.67	0.67
000013	企债指数	203.70	2016-06-30	201.42	2016-04-01	203.69	1.14
000022	沪公司债	175.48	2016-06-30	174.28	2016-04-01	175.48	0.70
000061	沪企债 30	142.45	2016-06-29	140.75	2016-04-26	142.33	0.18
上证基金类指数							
000011	基金指数	5702.34	2016-04-13	5607.75	2016-04-20	5644.23	-0.20

指数衍生品

指数名称	产品名称	交易所	产品代码	资产净值(亿元)
ETF				
上证50指数	博时上证50交易型开放式指数证券投资基金	上海证券交易所	510710.OF	1.63
上证可质押城投债指数	海富通上证可质押城投债交易型开放式指数证券投资基金	上海证券交易所	511220.OF	61.98
上证380指数	万家上证380交易型开放式指数证券投资基金	上海证券交易所	510680.OF	0.06
上证企债30指数	上证企债30交易型开放式指数证券投资基金	上海证券交易所	511210.OF	0.93
上证金融地产行业指数	上证金融地产交易型开放式指数发起式证券投资基金	上海证券交易所	510650.OF	0.60
上证医药卫生行业指数	上证医药卫生交易型开放式指数发起式证券投资基金	上海证券交易所	510660.OF	1.09
上证主要消费行业指数	上证主要消费交易型开放式指数发起式证券投资基金	上海证券交易所	510630.OF	2.38
上证5年期国债指数	上证5年期国债交易型开放式指数证券投资基金	上海证券交易所	511010.OF	6.37
上证50等权重指数	上证50等权重交易型开放式指数基金	上海证券交易所	510430.OF	0.92
上证180等权重指数	上证180等权重交易型开放式指数基金	上海证券交易所	510420.OF	1.22
上证自然资源指数	上证自然资源交易型开放式指数证券投资基金	上海证券交易所	510410.OF	0.75
上证380指数	上证380交易型开放式指数证券投资基金	上海证券交易所	510290.OF	2.62
上证180成长指数	上证180成长交易型开放式指数证券投资基金	上海证券交易所	510280.OF	0.56
上证国有企业100指数	上证国有企业100交易型开放式指数基金	上海证券交易所	510270.OF	0.24
上证非周期行业100指数	上证非周期行业100交易型开放式指数基金	上海证券交易所	510120.OF	0.33
上证新兴产业指数	上证新兴产业交易型开放式指数证券投资基金	上海证券交易所	510260.OF	0.85
上证180金融股指数	上证180金融交易型开放式指数证券投资基金	上海证券交易所	510230.OF	30.54
上证综合指数	富国上证综指交易型开放式指数证券投资基金	上海证券交易所	510210.OF	1.38
上证中小盘指数	上证中小盘交易型开放式指数证券投资基金	上海证券交易所	510220.OF	0.27
上证消费80指数	上证消费80交易型开放式指数证券投资基金	上海证券交易所	510150.OF	1.22
上证大宗商品股票指数	上证大宗商品股票交易型开放式指数基金	上海证券交易所	510170.OF	1.42
上证龙头企业指数	上证龙头企业交易型开放式指数证券投资基金	上海证券交易所	510190.OF	1.21
上证周期行业50指数	上证周期行业50交易型开放式指数基金	上海证券交易所	510110.OF	0.47
上证民营企业50指数	上证民营企业50交易型指数证券投资基金	上海证券交易所	510070.OF	0.82
上证社会责任指数	上证社会责任交易型开放式指数证券投资基金	上海证券交易所	510090.OF	1.01
上证180价值指数	上证180价值交易型开放式指数证券投资基金	上海证券交易所	510030.OF	1.40
上证中盘指数	易方达上证中盘交易型指数证券投资基金	上海证券交易所	510130.OF	2.58
上证超级大盘指数	上证超级大盘交易型开放式指数证券投资基金	上海证券交易所	510020.OF	2.24
上证180公司治理指数	上证180公司治理交易型指数证券投资基金	上海证券交易所	510010.OF	6.52
上证央企50指数	上证中央企业50开放式指数证券投资基金	上海证券交易所	510060.OF	2.33
上证红利指数	上证红利交易型开放式指数证券投资基金	上海证券交易所	510880.OF	5.77
上证180指数	上证180交易型开放式指数证券投资基金	上海证券交易所	510180.OF	161.91
上证50指数	上证50交易型开放式指数证券投资基金	上海证券交易所	510050.OF	268.54
上证50指数	中银国际·德国商业银行—上证50 A股指数 UCITS ETF	中欧国际交易所	B0C1.GR	0.18
上证50指数	中银保诚标智上证50ETF	香港交易所	3024.HK	0.80
上证50指数	中银保诚标智上证50ETF	台湾证券交易所	008201.TW	/
上证50指数	元大宝来上证50ETF	台湾证券交易所	006206.TT	9.84
上证50指数	野村上证50ETF	大阪证券交易所	1309.O	3.05
上证50指数	大华上证50ETF	新加坡交易所	USSE50.SP	1.51
上证180指数	富邦上证180ETF	台湾证券交易所	006205.TW	35.49
上证180两倍杠杆指数	富邦上证180单日正向两倍基金	台湾证券交易所	00633L.TT	61.89
上证180反向指数	富邦上证180单日反向一倍基金	台湾证券交易所	00634R.TT	2.69
指数基金				
上证50指数	长盛上证50指数分级证券投资基金	上海证券交易所	502040.OF	0.26
上证50指数	天弘上证50指数型发起式证券投资基金	上海证券交易所	001548.OF	0.31
上证50指数	国金上证50指数分级证券投资基金	上海证券交易所	502020.OF	0.26
上证50指数	易方达上证50指数分级证券投资基金	上海证券交易所	502048.OF	6.63
上证380指数	中邮上证380指数增强型证券投资基金	上海证券交易所	590007.OF	1.30
上证50指数	中海上证50指数增强型证券投资基金	上海证券交易所	399001.OF	1.37
上证综合指数	汇添富上证综合指数证券投资基金	上海证券交易所	470007.OF	13.73
上证50指数	易方达50指数证券投资基金	上海证券交易所	110003.OF	79.76
上证180指数	万家180指数证券投资基金	上海证券交易所	519180.OF	15.10

指标定义

1. 流通市值覆盖率

与全市场比较，考察指数样本股流通市值所占比例大小，该值越大表明市场代表性越强。

$$\text{算法：流通市值覆盖率} = \frac{MV_I}{MV_M}$$

其中， MV_I - 指数 2010-12-31 的流通市值；

MV_M - 如果是上证 50 指数、上证 180 指数，上证 380 指数，是上证 A 股 2010-12-31 的流通市值；

如果是上证综指，是上证综指 2010-12-31 的流通市值。

2. 总市值覆盖率

与全市场比较，考察指数样本股总市值所占比例大小，该值越大表明市场代表性越强。

$$\text{算法：总市值覆盖率} = \frac{TMV_I}{TMV_M}$$

其中， TMV_I - 指数 2010-12-31 的总市值；

TMV_M - 如果是上证 50 指数、上证 180 指数，上证 380 指数，是上证 A 股 2010-12-31 的总市值；

如果是上证综指，是上证综指 2010-12-31 的总市值。

3. 样本股日均成交金额

考察指数样本股总成交金额，反应考察期间市场资金向指数流向的情况，该值越大说明市场代表性越好。

$$\text{算法：样本股日均成交金额} = \text{mean} \left(\frac{\text{每日指数的成交金额}}{\text{每日样本股个数}} \right)$$

4. 换手率

考察指数的成交活跃程度，反映指数流动性的高低。

$$\text{算法：} TO = \frac{TTV}{TMN} = \frac{\sum TV_i}{\sum MN_i}$$

其中， TO - 换手率；

TTV - 总成交量；

TMN - 流通股本；

TV_i - 指数中第 i 只股票的成交量；

MN_i - 指数中第 i 只股票的流通股本

5. 税后利润

$$\text{算法：} PNP_I = \sum (Jlr_i \times TN_i / PN_i)$$

其中， PNP_I - 指数的税后利润；

Jlr_i - 指数中第 i 只股票的净利润；

TN_i - 指数中第 i 只股票的 A 股股本；

PN_i - 指数中第 i 只股票的公司股本（含 A、H 等股本）。

6. 每股收益

$$\text{算法：} PNP_I = \frac{\sum (Jlr_i \times TN_i / PN_i)}{\sum TN_i}$$

其中， PNP_I - 指数的每股收益；

Jlr_i - 指数中第 i 只股票的净利润；

TN_i - 指数中第 i 只股票的 A 股股本；

PN_i - 指数中第 i 只股票的公司股本（含 A、H 等股本）。

7. 股东权益

$$\text{算法：} PNA_I = \sum (Jzc_i \times TN_i / PN_i)$$

其中， PNA_I - 指数的股东权益；

Jzc_i - 指数中第 i 只股票的净资产；

TN_i - 指数中第 i 只股票的 A 股股本；

PN_i - 指数中第 i 只股票的公司股本（含 A、H 等股本）。

8. 每股净资产

$$\text{算法：} PNA_I = \frac{\sum (Jzc_i \times TN_i / PN_i)}{\sum TN_i}$$

其中， PNA_I - 指数的每股净资产；

Jzc_i - 指数中第 i 只股票的净资产；

TN_i - 指数中第 i 只股票的 A 股股本；

PN_i - 指数中第 i 只股票的公司股本（含 A、H 等股本）。

9. 总资产收益率

从总资产的角度考察指数样本股的收益情况，反映指数样本股与实体经济的关系。

$$\text{算法: } \text{ROTA} = \frac{\text{TNP} - \frac{\sum(\text{NP}_i \times \text{TN}_i / \text{PN}_i)}{\sum(\text{TA}_i \times \text{TN}_i / \text{PN}_i)}}{\text{TA}}$$

其中，ROTA- 总资产收益率；

TNP - 净利润（含少数股东损益）；

TA- 资产总额；

NP_i - 指数中第 i 只股票的净利润；

TA_i - 指数中第 i 只股票的总资产。

TN_i - 指数中第 i 只股票的 A 股股本；

PN_i - 指数中第 i 只股票的公司股本（含 A、H 等股本）。

10. 净资产收益率

考察指数样本股的股权资产的收益情况，反映指数样本股与实体经济的关系。

$$\text{算法: } \text{ROE} = \frac{\text{TNP} - \frac{\sum(\text{NP}_i \times \text{TN}_i / \text{PN}_i)}{\sum(\text{NA}_i \times \text{TN}_i / \text{PN}_i)}}{\text{TNA}}$$

其中，ROE - 净资产收益率

TNP - 净利润总额；

TNA- 净资产总额；

NP_i - 指数中第 i 只股票的净利润；

NA_i - 指数中第 i 只股票的净资产。

TN_i - 指数中第 i 只股票的 A 股股本；

PN_i - 指数中第 i 只股票的公司股本（含 A、H 等股本）。

11. 股东权益比率

$$\text{算法: } \text{ROR} = \frac{\text{TPR} - \frac{\sum(\text{PR}_i \times \text{TN}_i / \text{PN}_i)}{\sum(\text{TA}_i \times \text{TN}_i / \text{PN}_i)}}{\text{TA}}$$

其中，ROR - 股东权益比率；

TPR- 股东权益（含少数股东权益）；

TA - 资产总额；

PR_i - 指数中第 i 只股票的股东权益；

TA_i - 指数中第 i 只股票的总资产。

TN_i - 指数中第 i 只股票的 A 股股本；

PN_i - 指数中第 i 只股票的公司股本（含 A、H 等股本）。

12. 资产负债比率

$$\text{算法: } \text{ROD} = \frac{\sum(\text{TA}_i - \text{PR}_i) \times \text{TN}_i / \text{PN}_i}{\sum(\text{TA}_i \times \text{TN}_i / \text{PN}_i)}$$

其中，ROD- 资产负债比率；

PR_i - 指数中第 i 只股票的股东权益（含少数股东权益）；

TA_i - 指数中第 i 只股票的总资产。

TN_i - 指数中第 i 只股票的 A 股股本；

PN_i - 指数中第 i 只股票的公司股本（含 A、H 等股本）。

13. 季度末市值规模分布

上证 180、50、380 指数成分股的市值规模分布：

流通市值占市场比例（%）：跟上海 A 股股票去比；

上证综合指数成份股的市值规模分布：

流通市值占市场比例（%）：跟上海 A、B 股股票去比