

上证指数季报

2016年10-12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（2016.10-2016.12）	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12月31日）和四季度涨跌幅

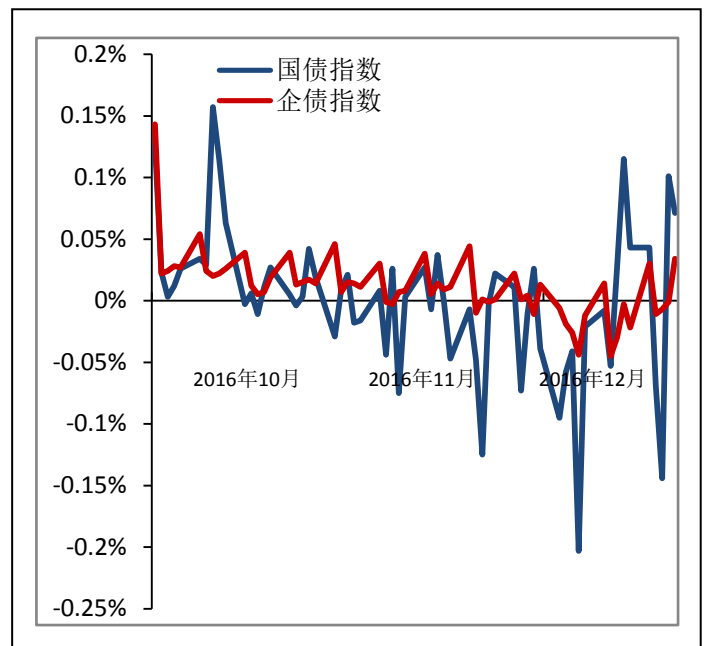
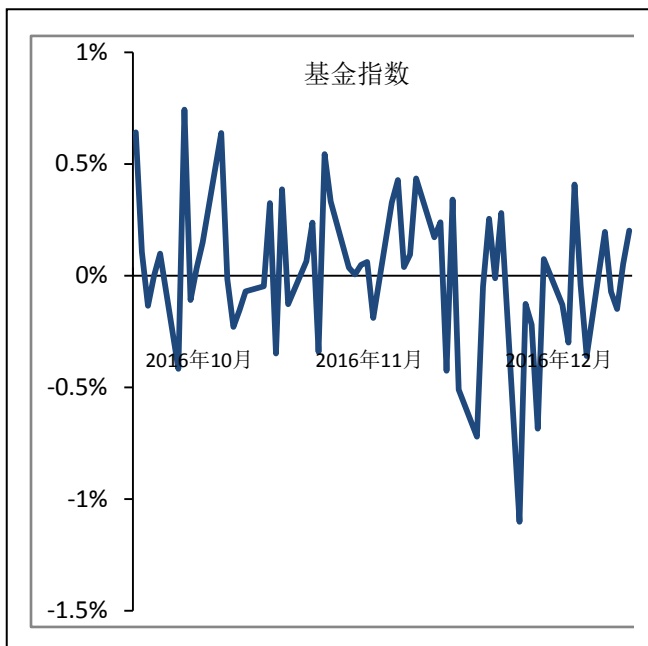
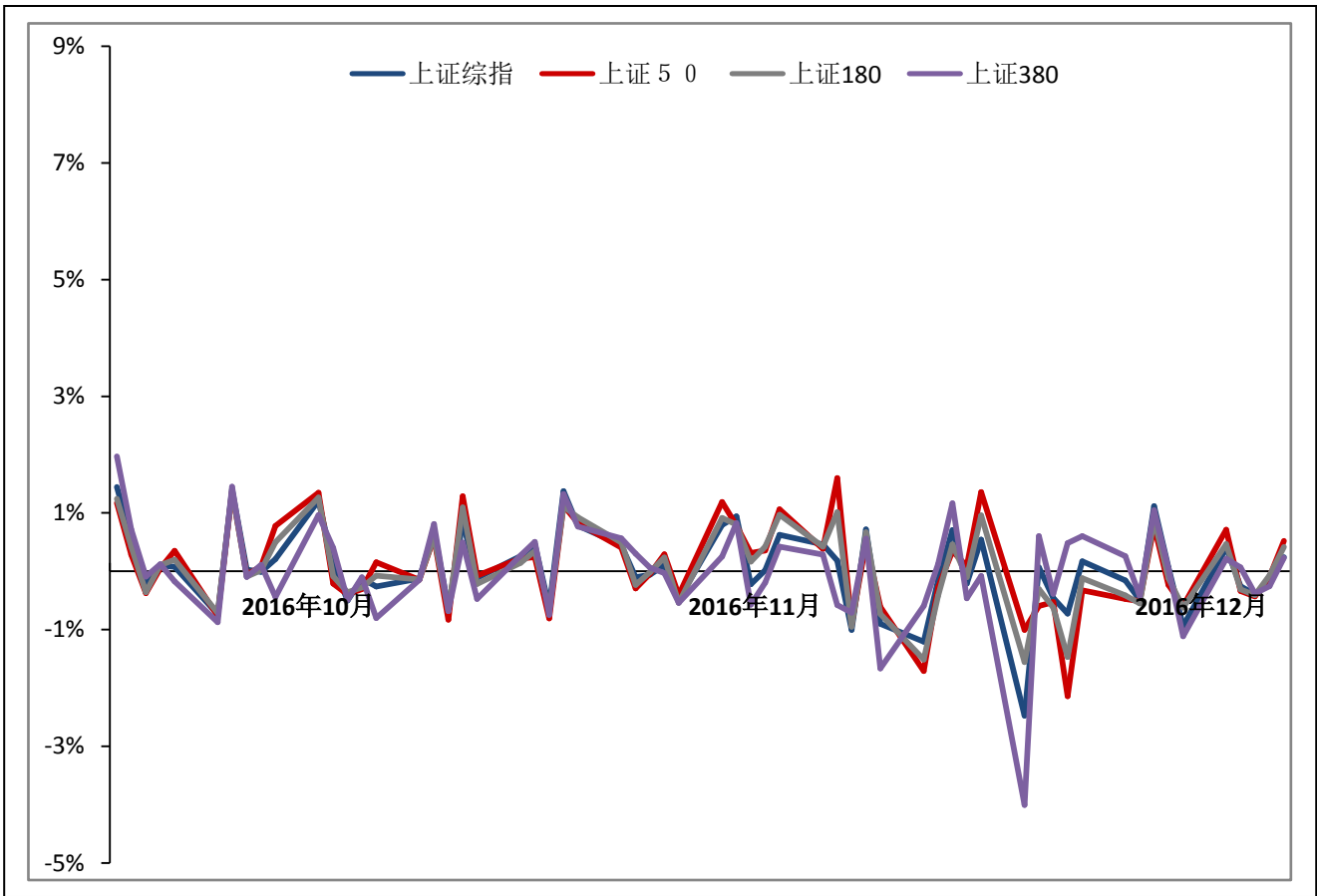
上证180指数	7224.60	3.82%	上证企债指数	209.03	0.70%
上证50指数	2286.90	5.03%	上证国债指数	159.79	0.04%
上证380指数	5542.39	0.66%	上证基金指数	5733.60	0.86%
上证综指指数	3103.64	3.29%			

本季度180指数与上证综指的日收益率相关系数为92.77%，显示了较强的市场代表性。12月31日，上证180指数成份股的流通市值占上海A股市场的67%，总市值占61%，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67.78%，流通市值占上海A股市场的18%，总市值占上海A股市场的19%，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0.62元、0.71元和0.34元。12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12.34倍、10.43倍和29.79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12.76倍、10.54倍和42.09倍。

本季度上证180基建指数涨幅17.405%，在沪市A股指数体系中涨幅居前。本季度上证信息指数跌幅-6.24%，在沪市A股指数体系中跌幅居前。

上证指数季度走势 (2016.10-2016.12)

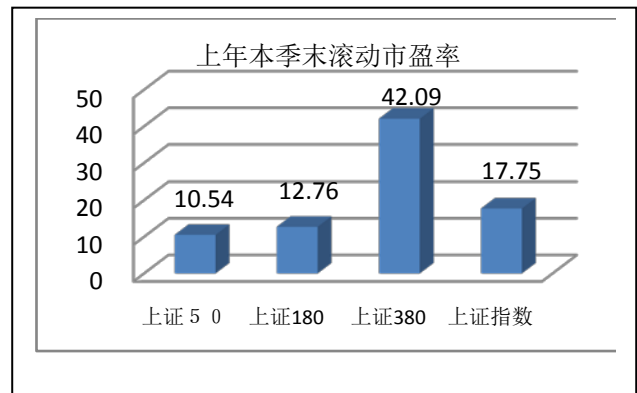
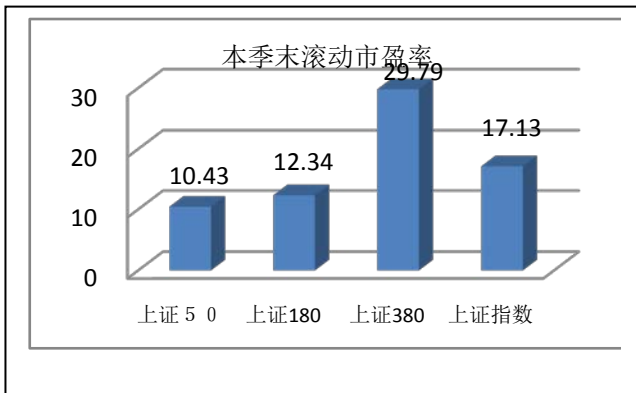


指数基本资料

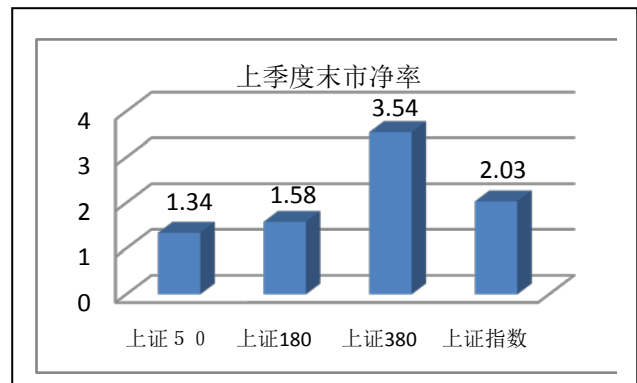
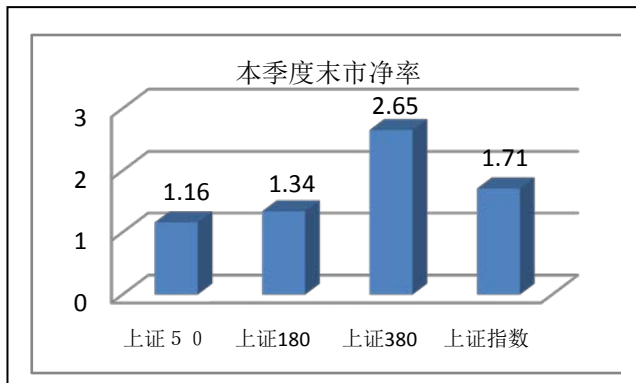
一、上证指数收益率和波动率

	累计收益%					日收益标准差%				
	10月	11月	12月	季度	上年本季	10月	11月	12月	季度	上年本季
上证50	3.36	7.51	-5.48	5.03	12.80	0.63	0.69	0.77	0.75	1.60
上证180	3.04	6.50	-5.39	3.82	13.72	0.60	0.61	0.70	0.69	1.59
上证380	2.49	2.34	-4.03	0.66	22.72	0.76	0.58	1.05	0.84	1.96
上证指数	3.19	4.82	-4.50	3.29	15.93	0.62	0.58	0.75	0.69	1.56

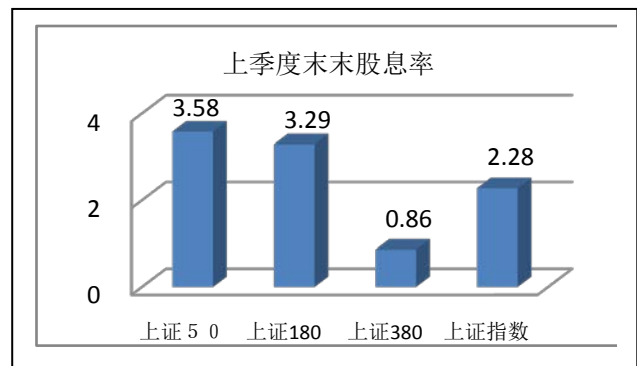
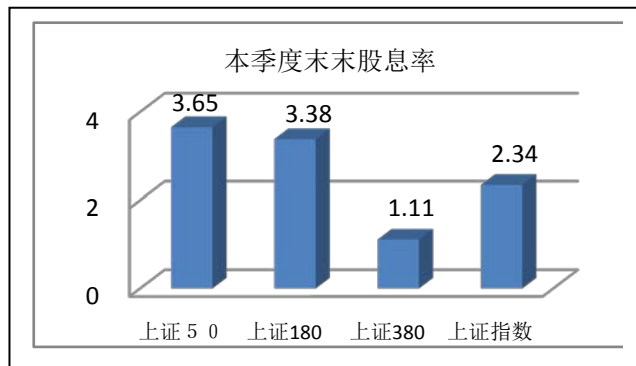
二、上证指数市盈率



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)	11.88	17.23	5.40	28.46
指数总市值覆盖率%	42	61	19	100
指数流通市值 (万亿元)	11.51	15.96	4.32	24.00
指数流通市值覆盖率%	48	67	18	100
样本股日均成交额 (亿元)	7.65	4.48	1.44	1.82
换手率%	14.82	24.27	70.44	41.33
指数日收益相关系数	96.97	100.00	67.78	92.77

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)	11,370.61	13,770.67	1,692.43	15,524.65
股东权益 (亿元)	102,405.99	128,770.20	20,376.70	165,975.21
每股收益 (元)	0.71	0.62	0.34	0.47
每股净资产 (元)	6.41	5.81	4.07	5.08
净资产收益率%	11.10	10.69	8.31	9.35
股东权益比率%	10.20	11.41	38.41	13.26
资产负债比率%	89.80	88.59	61.59	86.74
资产报酬率%	1.13	1.22	3.19	1.24

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	6.82	20,710.73	79.77	17.99
原材料	2	1.06	965.34	4.83	0.84
工业	9	2.86	12,942.89	27.61	11.24
可选消费	2	0.98	3,093.41	14.61	2.69
主要消费	2	2.67	5,259.46	47.57	4.57
医药卫生	1	1.22	784.94	7.56	0.68
金融地产	27	22.69	68,973.44	82.88	59.91
信息技术	1	1.35	304.41	4.10	0.26
电信业务	2	12.50	1,787.66	53.76	1.55
公用事业	1	1.82	299.43	3.14	0.26

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	6	13.64	21,606.27	83.22	13.53
原材料	18	9.57	7,369.99	36.91	4.62
工业	39	12.38	24,789.28	52.88	15.53
可选消费	19	9.27	7,642.33	36.08	4.79
主要消费	9	12.00	6,470.26	58.52	4.05
医药卫生	10	12.20	4,247.07	40.89	2.66
金融地产	59	49.58	78,811.61	94.71	49.37
信息技术	9	12.16	2565.98	34.55	1.61
电信业务	3	18.75	2,027.31	60.97	1.27
公用事业	8	14.55	4,104.41	42.98	2.57

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	15	34.09	2,217.19	8.54	5.13
原材料	54	28.72	6,151.65	30.81	14.23
资本品	78	37.50	7,545.48	24.18	17.45
商业服务与商业用品	12	28.57	1,204.49	31.71	2.79
运输	27	41.54	3,560.41	29.98	8.23
汽车与汽车零部件	21	35.59	3,114.97	34.47	7.20
耐用消费品与服装	16	24.62	1,146.13	23.93	2.65
消费者服务	5	26.32	764.37	51.43	1.77
媒体	8	28.57	1,452.17	41.99	3.36
零售业	13	38.24	1,382.27	57.42	3.20
食品、饮料与烟草	20	31.25	1974.40	20.07	4.57
家庭与个人用品	1	25.00	82.45	21.50	0.19
医疗保健设备与服务	2	22.22	208.85	51.04	0.48
制药、生物科技和生命科学	35	47.95	4074.17	40.83	9.42
软件与服务	11	35.48	1,163.35	35.46	2.69
技术硬件与设备	15	40.54	1287.05	35.69	2.98
半导体产品与设备	4	66.67	437.87	81.26	1.01
通信设备	5	33.33	719.76	40.53	1.66
公用事业	21	38.18	3072.38	32.17	7.11

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	45	27,791.01	26,048.17
原材料	195	24,305.07	20,083.92
工业	330	56,225.61	47,193.28
可选消费	216	29,507.29	21,376.48
主要消费	76	13,606.88	11,073.33
医药卫生	85	13,270.62	10,428.56
金融地产	125	92,438.12	83,394.30
信息技术	76	10,495.72	7,467.35
电信业务	18	3,720.83	3,352.20
公用事业	58	13,246.46	9,588.65

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%
600050	中国联通	76.14	600773	西藏城投	-23.87
600158	中体产业	46.95	600074	保千里	-17.56
601668	中国建筑	43.60	600570	恒生电子	-15.73
601800	中国交建	37.59	600503	华丽家族	-15.67
601186	中国铁建	32.74	600340	华夏幸福	-15.34
600019	宝钢股份	29.59	600446	金证股份	-14.49
600150	中国船舶	28.00	600549	厦门钨业	-13.31
600528	中铁二局	26.24	600325	华发股份	-12.45
601390	中国中铁	25.50	600516	方大炭素	-12.39
600005	武钢股份	23.55	600066	宇通客车	-11.20

上证 50 指数

代码	简称	涨幅%	代码	简称	跌幅%
600050	中国联通	76.14	601198	东兴证券	-8.65
601668	中国建筑	43.60	600637	东方明珠	-5.67
601800	中国交建	37.59	600999	招商证券	-5.00
601186	中国铁建	32.74	600048	保利地产	-4.90
601390	中国中铁	25.50	600893	中航动力	-4.58
601989	中国重工	14.35	600547	山东黄金	-4.40
601628	中国人寿	12.52	601601	中国太保	-3.41
600519	贵州茅台	12.16	600036	招商银行	-2.22

601006	大秦铁路	11.67	600016	民生银行	-1.94
600028	中国石化	11.32	600958	东方证券	-1.90

上证 380 指数

代码	简称	涨幅%	代码	简称	跌幅%
600614	鼎立股份	43.73	600623	华谊集团	-28.70
600098	广州发展	36.00	600007	中国国贸	-21.96
600012	皖通高速	35.27	600845	宝信软件	-20.72
601020	华钰矿业	34.92	600278	东方创业	-19.25
600682	南京新百	33.68	601021	春秋航空	-18.66
600818	中路股份	30.95	600289	亿阳信通	-18.30
601801	皖新传媒	28.53	600119	长江投资	-18.13
600809	山西汾酒	28.11	600343	航天动力	-18.11
600497	驰宏锌锗	27.59	600986	科达股份	-17.13
600803	新奥股份	25.31	600418	江淮汽车	-16.71

上证综指

代码	简称	涨幅%	代码	简称	跌幅%
601882	海天精工	1582.67	600758	红阳能源	-40.29
603859	能科股份	608.62	600076	康欣新材	-30.44
603633	徕木股份	507.56	600623	华谊集团	-28.70
603990	麦迪科技	468.21	600330	天通股份	-24.98
603319	湘油泵	440.15	600773	西藏城投	-23.87
603160	汇顶科技	429.04	603958	哈森股份	-22.27
603559	中通国脉	421.18	600696	匹凸匹	-22.15
603336	宏辉果蔬	405.59	600007	中国国贸	-21.96
603716	塞力斯	368.34	600071	凤凰光学	-21.43
603777	来伊份	354.93	600845	宝信软件	-20.72

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)
601668	中国建筑	3141.06	601668	中国建筑	353.40
600050	中国联通	1301.48	600050	中国联通	206.70
600030	中信证券	1120.50	601989	中国重工	116.41
601766	中国中车	935.77	601899	紫金矿业	112.04
601186	中国铁建	900.63	601099	太平洋	110.97
601318	中国平安	884.57	601988	中国银行	93.02
600547	山东黄金	838.16	601288	农业银行	92.43
601989	中国重工	829.70	601618	中国中冶	90.55
600887	伊利股份	825.68	601766	中国中车	90.40

601390	中国中铁	716.82	601600	中国铝业	87.99
--------	------	--------	--------	------	-------

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)
601668	中国建筑	3141.06	601668	中国建筑	353.40
600050	中国联通	1301.48	600050	中国联通	206.70
600030	中信证券	1120.50	601989	中国重工	116.41
601766	中国中车	935.77	601988	中国银行	93.02
601186	中国铁建	900.63	601288	农业银行	92.43
601318	中国平安	884.57	601766	中国中车	90.40
600547	山东黄金	838.16	601390	中国中铁	79.77
601989	中国重工	829.70	601186	中国铁建	77.86
600887	伊利股份	825.68	600028	中国石化	73.26
601390	中国中铁	716.82	600030	中信证券	65.66

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)
600497	驰宏锌锗	632.74	600497	驰宏锌锗	81.79
600718	东软集团	391.65	601880	大连港	63.53
600487	亨通光电	381.78	600166	福田汽车	57.88
600113	浙江东日	355.47	600170	上海建工	44.07
600666	奥瑞德	344.99	600657	信达地产	32.99
601801	皖新传媒	265.05	600282	南钢股份	26.76
601020	华钰矿业	245.23	600256	广汇能源	26.55
600657	信达地产	233.32	601168	西部矿业	25.90
600500	中化国际	232.32	601636	旗滨集团	25.89
600614	鼎立股份	229.49	600039	四川路桥	25.63

上证综指

代码	简称	成交金额 (亿元)	代码	简称	成交股数 (亿股)
601668	中国建筑	3141.06	601668	中国建筑	353.40
600050	中国联通	1301.48	600050	中国联通	206.70
600030	中信证券	1120.50	601989	中国重工	116.41
601766	中国中车	935.77	601899	紫金矿业	112.04
601186	中国铁建	900.63	601099	太平洋	110.97
601318	中国平安	884.57	600868	梅雁吉祥	104.46
600547	山东黄金	838.16	601988	中国银行	93.02
601989	中国重工	829.70	601288	农业银行	92.43
600887	伊利股份	825.68	601618	中国中冶	90.55
601390	中国中铁	716.82	601766	中国中车	90.40

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%
601857	中国石油	12,872.81	能源	62.16	11.06	59.54	7.90
601398	工商银行	11,889.90	金融地产	17.03	10.22	14.81	7.30
601288	农业银行	9,115.71	金融地产	13.06	7.83	11.36	5.59
601988	中国银行	7,250.33	金融地产	10.39	6.23	9.03	4.45
600028	中国石化	5,169.68	能源	24.96	4.44	23.91	3.17
601628	中国人寿	5,016.39	金融地产	7.19	4.31	6.25	3.08
600519	贵州茅台	4,197.58	主要消费	79.73	3.61	64.34	2.58
601318	中国平安	3,838.01	金融地产	5.50	3.30	4.78	2.36
600036	招商银行	3,630.69	金融地产	5.20	3.12	4.52	2.23
600000	浦发银行	3,504.32	金融地产	5.02	3.01	4.37	2.15

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	982.21	汽车与汽车零部件	30.58	2.17
600309	万华化学	465.55	原材料	7.19	1.03
601888	中国国旅	423.69	消费者服务	54.14	0.94
600027	华电国际	403.21	公用事业	12.56	0.89
601808	中海油服	379.83	能源	16.94	0.84
600660	福耀玻璃	373.16	汽车与汽车零部件	11.62	0.82
601992	金隅股份	371.92	原材料	5.74	0.82
601158	重庆水务	356.64	公用事业	11.11	0.79
601801	皖新传媒	349.50	媒体	22.84	0.77
600170	上海建工	337.34	资本品	4.23	0.74

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
601857	中国石油	12,872.81	12,872.81	能源
601398	工商银行	11,889.90	11,889.90	金融地产
601288	农业银行	9,115.71	9,115.71	金融地产
601988	中国银行	7,250.33	7,250.33	金融地产
600028	中国石化	5,169.68	5,169.68	能源
601628	中国人寿	5,016.39	5,016.39	金融地产
600519	贵州茅台	4,197.58	4,197.58	主要消费
601318	中国平安	3,838.01	3,838.01	金融地产
600036	招商银行	3,630.69	3,630.69	金融地产
600000	浦发银行	3,504.32	3,326.10	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	0.23	87.00	0.28
100~500 亿	102	21.61	30,520.58	31.92
500~1000 亿	38	84.44	25,526.16	83.72
1000~5000 亿	33	94.29	64,853.83	96.27
5000 亿元以上	6	100.00	51,314.82	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	1.06	2,170.21	2.27
500~1000 亿	12	26.67	8,751.90	28.70
1000~5000 亿	27	77.14	56,550.21	83.95
5000 亿元以上	6	100.00	51,314.82	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	5	2.86	230.35	3.12
50~100 亿	138	31.65	10,720.14	34.27
100~200 亿	172	58.11	23,876.32	57.76
200~500 亿	63	35.80	17,352.05	31.97
500 亿元以上	2	2.33	1,775.57	1.19

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	49	796.47	763.81
30~50 亿	178	7,514.27	6,307.29
50~100 亿	439	31,512.18	24,645.63
100~200 亿	296	41,334.88	30,174.14
200~500 亿	176	54,280.67	41,677.06
500 亿元以上	86	149,169.17	136,438.32

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. 12. 30)	季度涨跌%
上证 180 系列							
000010	上证 180	7753.75	2016.11.29	6978.43	2016.10.10	7224.60	3.82
000016	上证 50	2455.43	2016.11.29	2185.47	2016.10.10	2286.90	5.03
000018	180 金融	4881.98	2016.11.28	4456.16	2016.12.26	4529.21	1.24
000021	180 治理	909.59	2016.11.29	808.71	2016.10.10	846.22	4.98
000025	180 基建	2062.29	2016.11.29	1607.64	2016.10.10	1875.81	17.41
000026	180 资源	2526.49	2016.11.28	2221.03	2016.10.10	2314.87	3.91
000027	180 运输	986.08	2016.12.02	886.88	2016.10.10	920.53	4.33
000043	超大盘	2279.70	2016.12.01	1893.80	2016.10.10	2116.80	12.49
000044	上证中盘	3489.15	2016.11.29	3192.32	2016.10.10	3250.95	1.95
000050	50 等权	2458.12	2016.11.29	2120.28	2016.10.10	2262.93	7.17
000054	上证海外	1140.52	2016.11.29	1032.63	2016.10.17	1065.11	3.29
上证 180 风格指数							
000028	180 成长	2903.76	2016.11.29	2614.92	2016.10.10	2685.51	2.89
000029	180 价值	3643.83	2016.11.29	3275.75	2016.10.18	3425.85	4.81
000030	180R 成长	1884.58	2016.11.29	1706.07	2016.10.10	1743.83	2.50
000031	180R 价值	2846.38	2016.11.29	2549.40	2016.10.10	2667.32	4.93
上证规模指数							
000009	上证 380	5866.61	2016.11.28	5443.26	2016.12.13	5542.39	0.66
000045	上证小盘	4955.92	2016.11.28	4591.78	2016.12.13	4662.49	0.45
000046	上证中小	4146.40	2016.11.29	3841.91	2016.12.26	3883.96	1.22
000047	上证全指	3174.32	2016.11.29	2894.95	2016.10.10	2968.42	2.90
上证全指风格指数							
000057	全指成长	3334.30	2016.11.29	3049.81	2016.10.10	3101.28	1.93
000058	全指价值	3651.06	2016.11.29	3273.23	2016.10.10	3423.46	4.93
000059	全 R 成长	2808.78	2016.11.29	2582.80	2016.12.26	2616.35	0.71
000060	全 R 价值	3463.70	2016.11.29	3116.28	2016.10.10	3248.39	4.61
上证行业指数							
000032	上证能源	1655.22	2016.11.14	1502.54	2016.10.14	1562.84	4.88
000033	上证材料	1938.08	2016.11.28	1714.17	2016.10.10	1788.07	4.87
000034	上证工业	2559.98	2016.11.29	2058.95	2016.10.10	2293.55	11.82
000035	上证可选	2891.08	2016.11.29	2679.71	2016.10.10	2729.43	2.39
000036	上证消费	6608.68	2016.11.29	6002.26	2016.10.10	6329.85	5.79
000037	上证医药	6228.75	2016.10.19	5873.74	2016.12.15	5954.09	-1.08
000038	上证金融	4597.64	2016.11.28	4208.69	2016.12.26	4273.17	0.62
000039	上证信息	4159.06	2016.11.16	3704.12	2016.12.26	3740.92	-6.24
000040	上证电信	3359.40	2016.12.01	3014.36	2016.10.10	3075.71	3.72
000041	上证公用	2316.96	2016.12.02	2132.57	2016.12.26	2152.88	1.07

代码	简称	最高 (日期)	最低 (日期)	收盘 (2016. 12. 30)	季度涨跌%		
上证行业策略指数							
000070	能源等权	2997.77	2016.11.14	2651.28	2016.12.26	2702.05	1.54
000071	材料等权	3125.27	2016.11.28	2789.38	2016.10.10	2907.03	4.77
000072	工业等权	3273.66	2016.11.29	2795.13	2016.10.10	3009.20	8.05
000073	可选等权	3452.06	2016.11.29	3216.60	2016.10.10	3275.00	2.31
000074	消费等权	5805.20	2016.11.29	5368.41	2016.10.10	5612.62	4.84
000075	医药等权	8628.84	2016.11.29	8076.85	2016.12.15	8206.72	-1.57
000076	金融等权	4856.69	2016.11.28	4393.88	2016.10.17	4478.53	1.56
000077	信息等权	5639.24	2016.11.23	4976.12	2016.12.26	5027.37	-6.11
000078	电信等权	3312.57	2016.12.01	2793.55	2016.10.10	3112.54	13.32
000079	公用等权	2691.18	2016.12.02	2470.70	2016.12.26	2497.25	0.28
上证央企、民企、国企主题指数							
000042	上证央企	1530.74	2016.11.29	1326.04	2016.10.10	1410.54	6.85
000049	上证民企	1623.69	2016.11.28	1508.38	2016.12.26	1521.34	-0.95
000055	上证地企	1110.81	2016.11.29	1002.16	2016.10.17	1034.64	3.12
000056	上证国企	1008.13	2016.11.29	892.13	2016.10.10	935.49	5.17
上证其他主题指数							
000015	红利指数	2761.60	2016.11.29	2486.58	2016.10.10	2574.13	3.90
000048	责任指数	1309.78	2016.11.29	1169.85	2016.10.10	1214.89	4.09
000062	上证沪企	2379.01	2016.12.12	2190.42	2016.10.10	2271.53	4.25
000063	上证周期	2943.49	2016.11.28	2694.62	2016.10.18	2745.86	1.70
000064	非周期	2668.89	2016.11.29	2317.12	2016.10.10	2477.13	7.50
000065	上证龙头	3235.15	2016.11.29	2946.38	2016.10.10	3041.95	3.72
000066	上证商品	1838.83	2016.11.28	1623.42	2016.10.10	1693.52	4.42
000067	上证新兴	7100.11	2016.11.29	6547.84	2016.12.26	6620.16	1.12
000068	上证资源	2103.43	2016.11.28	1839.24	2016.10.10	1922.07	4.62
000069	消费 80	3882.24	2016.11.29	3590.04	2016.10.10	3694.77	3.35
上证综合类指数							
000001	上证指数	3301.21	2016.11.29	3014.62	2016.10.10	3103.64	3.29
000002	A 股指数	3456.92	2016.11.29	3155.55	2016.10.10	3249.59	3.32
000003	B 股指数	358.95	2016.10.13	333.56	2016.10.17	341.80	-3.48
000004	工业指数	2626.44	2016.11.29	2415.61	2016.10.10	2486.30	3.49
000005	商业指数	4645.06	2016.11.23	4081.54	2016.12.26	4126.27	0.16
000006	地产指数	7573.06	2016.11.30	5709.65	2016.10.10	6564.42	11.13
000007	公用指数	6348.80	2016.11.29	5436.64	2016.10.10	5979.60	10.63
000008	综合指数	2875.73	2016.11.28	2654.67	2016.12.26	2690.55	1.22
000017	新综指	2786.88	2016.11.29	2544.19	2016.10.10	2619.89	3.31
000020	中型综指	1683.34	2016.11.23	1524.70	2016.12.13	1571.27	2.02
000090	上证流通	1215.22	2016.11.29	1110.15	2016.10.10	1141.79	3.17
上证行业指数固定收益指数							
000012	国债指数	160.86	2016.11.07	159.37	2016.12.20	159.79	0.04
000013	企债指数	209.43	2016.12.12	207.86	2016.10.10	209.03	0.70
000022	沪公司债	180.18	2016.11.29	179.01	2016.10.10	179.49	0.38
000061	沪企债 30	144.70	2016.10.18	141.71	2016.12.23	142.21	-1.38
上证基金类指数							
000011	基金指数	5927.80	2016.11.29	5690.18	2016.10.10	5733.60	0.86

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	1.39
上证可质押城投债指数	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	60.24
上证 380 指数	万家上证 50 交易型开放式指数证券投资基金	上海证券交易所	510680.OF	0.05
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	0.13
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	2.08
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	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	0.50
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	5.99
上证 50 等权重指数	上证 50 等权重交易型开放式指数证券投资基金	上海证券交易所	510430.OF	0.97
上证 180 等权重指数	上证 180 等权重交易型开放式指数证券投资基金	上海证券交易所	510420.OF	1.06
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	0.78
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	2.59
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	0.53
上证国有企业 100 指数	上证国有企业 100 交易型开放式指数证券投资基金	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 交易型开放式指数证券投资基金	上海证券交易所	510120.OF	0.32
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	0.83
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	33.77
上证综合指数	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	1.43
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	0.24
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	1.16
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证券投资基金	上海证券交易所	510170.OF	1.49
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 交易型开放式指数证券投资基金	上海证券交易所	510110.OF	0.39
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	0.81
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	1.05
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	1.37
上证中盘指数	易方达上证中盘交易型开放式指数证券投资基金	上海证券交易所	510130.OF	2.56
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	2.67
上证 180 公司治理指数	上证 180 公司治理交易型开放式指数证券投资基金	上海证券交易所	510010.OF	5.03
上证央企 50 指数	上证中央企业 50 交易型开放式指数证券投资基金	上海证券交易所	510060.OF	2.21
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	8.26
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	171.34
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	293.08
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	BOC1.GR	0.77
上证 50 指数	中银保诚标智上证 50ETF	香港交易所	3024.HK	0.73
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	10.35
上证 50 指数	野村上证 50ETF	大阪证券交易所	1309.0	2.93
上证 50 指数	大华上证 50ETF	新加坡交易所	USSE50.SP	1.61
上证 180 指数	富邦上证 180ETF	台湾证券交易所	006205.TW	37.06
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	60.60
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	1.57
指数基金				
上证港股通指数	长信上证港股通指数型发起式证券投资基金	上海证券交易所	519931.OF	0.17
上证 5 年期国债指数	银华上证 5 年期国债指数证券投资基金	上海证券交易所	003817.OF	2.00
上证 10 年期国债指数	银华上证 10 年期国债指数证券投资基金	上海证券交易所	003814.OF	2.00
上证 50AH 优选指数	华夏沪港通上证 50AH 优选指数证券投资基金 (LOF)	上海证券交易所	501050.OF	3.76
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	0.27
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	1.10
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	0.23
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	6.30
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	1.16
上证 180 指数	万家 180 指数证券投资基金	上海证券交易所	519180.O	28.63

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