

上证指数季报

2014年4-6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（2014. 4-2014. 6） | 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（2014年6月30日）和二季度涨跌幅

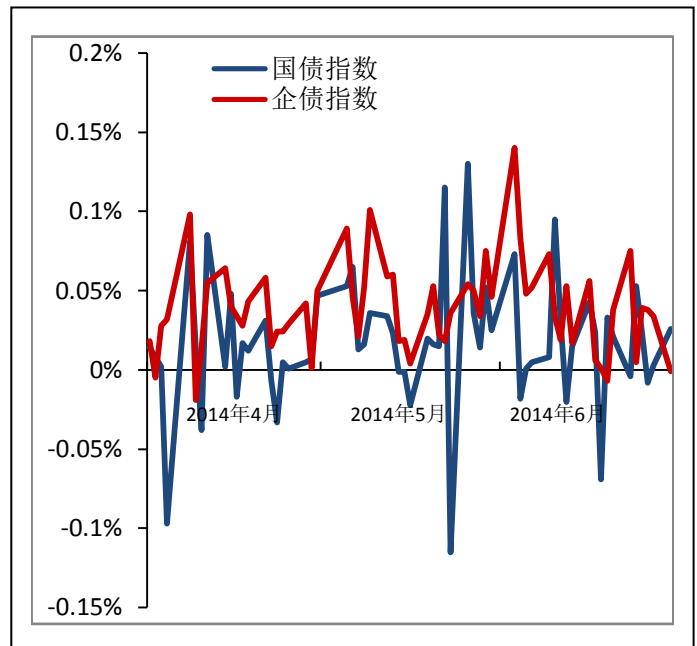
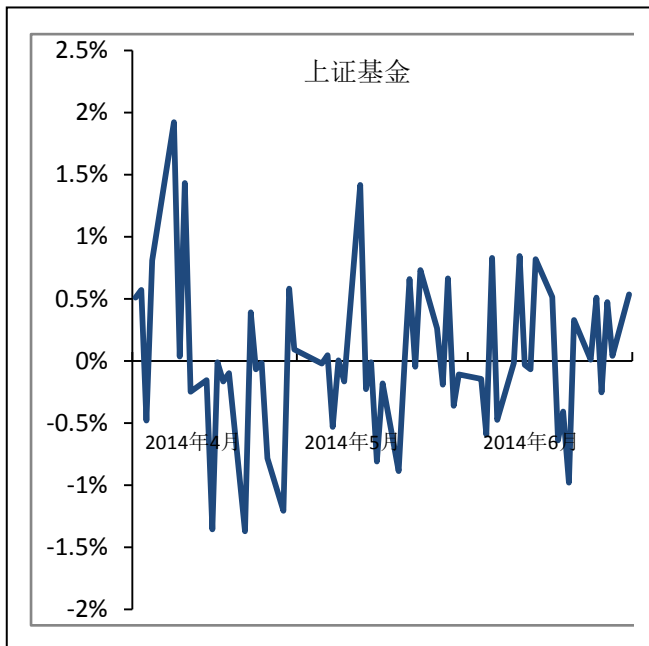
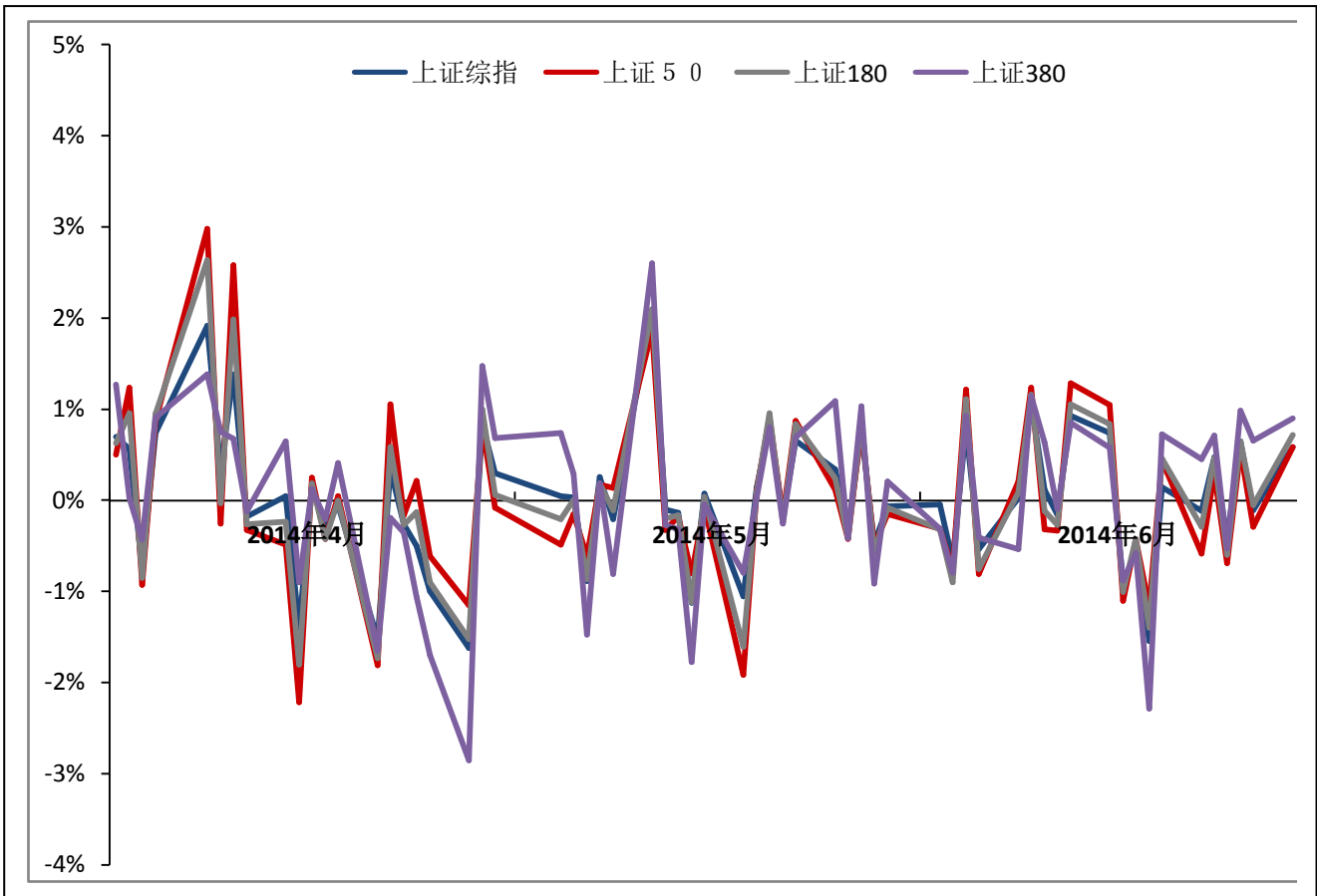
| | | | | | |
|---------|----------|-------|--------|----------|-------|
| 上证180指数 | 4729.205 | 0.74% | 上证企债指数 | 172.823 | 2.40% |
| 上证50指数 | 1482.405 | 1.13% | 上证国债指数 | 142.015 | 1.05% |
| 上证380指数 | 3367.91 | 1.34% | 上证基金指数 | 3757.494 | 1.71% |
| 上证综指指数 | 2048.327 | 0.74% | | | |

本季度180指数与上证综指的日收益率相关系数为97.59%，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73%，总市值占71%，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82.19%，流通市值占上海A股市场的18%，总市值占上海A股市场的20%，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0.71元、0.78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7.85倍、7.16倍和20.26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8.59倍、7.89倍和20.02倍。

本季度上证信息等权重指数涨幅10.172%，上证180运输指数跌幅5.651%，分别在沪市A股指数体系中涨跌幅居前。

上证指数季度走势 (2014.4-2014.6)

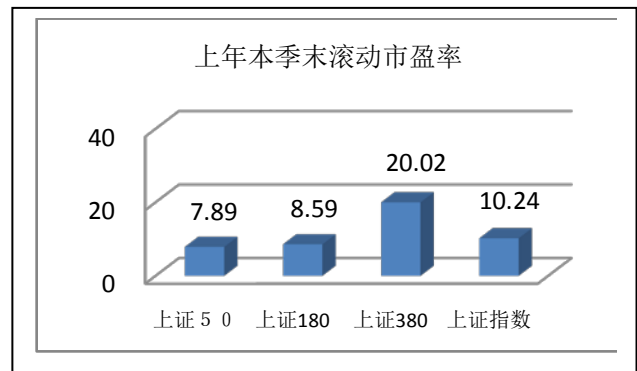
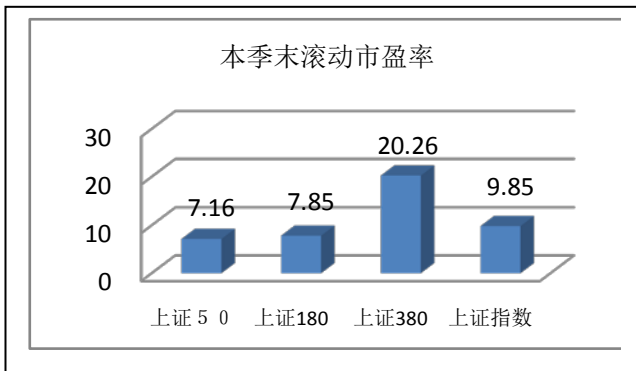


指数基本资料

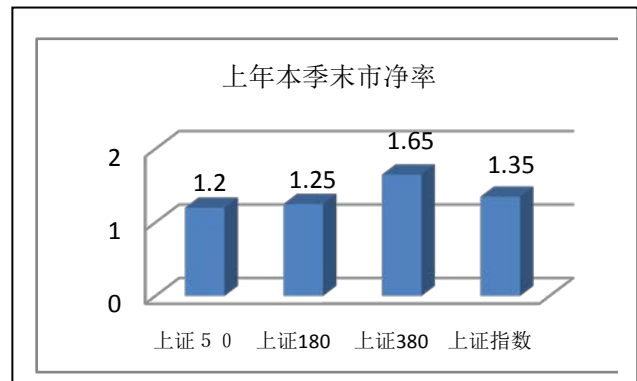
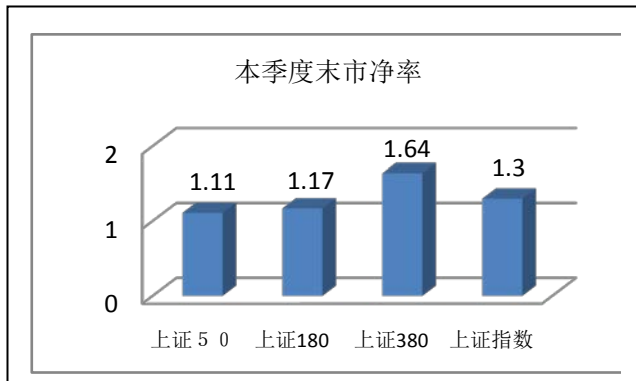
一、上证指数收益率和波动率

| | 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 | 1.98 | -0.85 | 0.02 | 1.13 | -13.43 | 1.22 | 0.75 | 0.77 | 0.95 | 1.54 |
| 上证180 | 0.69 | -0.32 | 0.37 | 0.74 | -11.67 | 1.09 | 0.78 | 0.74 | 0.89 | 1.45 |
| 上证380 | -1.24 | 0.50 | 2.10 | 1.34 | -9.53 | 1.08 | 0.97 | 0.86 | 0.98 | 1.37 |
| 上证指数 | -0.34 | 0.63 | 0.45 | 0.74 | -11.51 | 0.90 | 0.70 | 0.66 | 0.76 | 1.20 |

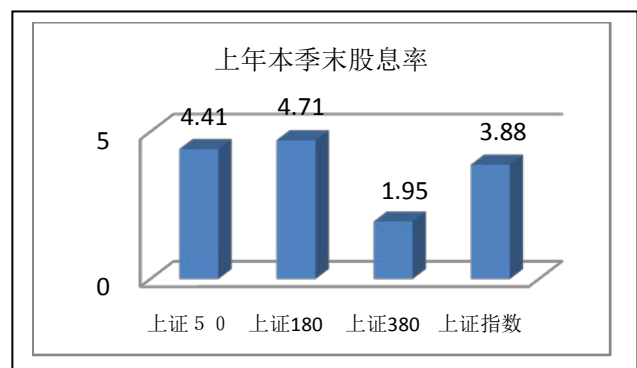
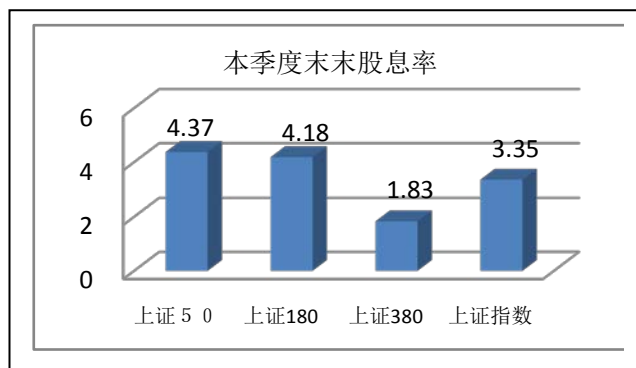
二、上证指数市盈率



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) | 7.24 | 10.50 | 2.91 | 14.94 |
| 指数总市值覆盖率% | 49.00 | 71.00 | 20.00 | 100.00 |
| 指数流通市值 (万亿元) | 6.94 | 9.79 | 2.47 | 13.51 |
| 指数流通市值覆盖率% | 52.00 | 73.00 | 18.00 | 100.00 |
| 样本股日均成交额 (亿元) | 3.07 | 1.73 | 0.60 | 0.69 |
| 换手率% | 8.92 | 12.32 | 44.17 | 21.58 |
| 指数日收益相关系数 | 97.76 | 100.00 | 82.19 | 97.59 |

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) | 10107.73 | 13361.24 | 1396.48 | 14763.14 |
| 股东权益 (亿元) | 65048.05 | 89993.03 | 17761.32 | 114794.20 |
| 每股收益 (元) | 0.78 | 0.71 | 0.30 | 0.56 |
| 每股净资产 (元) | 5.04 | 4.77 | 3.77 | 4.36 |
| 净资产收益率% | 15.54 | 14.85 | 7.86 | 12.86 |
| 股东权益比率% | 10.24 | 10.76 | 34.02 | 12.59 |
| 资产负债比率% | 89.76 | 89.24 | 65.98 | 87.41 |
| 资产报酬率% | 1.59 | 1.60 | 2.67 | 1.62 |

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 | 4 | 10.00 | 19631.12 | 86.69 | 28.27 |
| 原材料 | 4 | 2.37 | 1424.69 | 13.08 | 2.05 |
| 工业 | 10 | 4.31 | 5657.78 | 27.28 | 8.15 |
| 可选消费 | 4 | 2.48 | 2272.94 | 21.88 | 3.27 |
| 主要消费 | 3 | 4.23 | 2557.26 | 38.83 | 3.68 |
| 医药卫生 | 2 | 3.70 | 642.51 | 13.45 | 0.93 |
| 金融地产 | 21 | 19.81 | 36258.19 | 74.90 | 52.21 |
| 电信业务 | 1 | 6.67 | 684.65 | 48.12 | 0.99 |

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 | 11 | 27.50 | 20926.78 | 92.42 | 21.37 |
| 原材料 | 21 | 12.43 | 5216.59 | 47.89 | 5.33 |
| 工业 | 32 | 13.79 | 9599.83 | 46.29 | 9.80 |
| 可选消费 | 19 | 11.80 | 4855.69 | 46.74 | 4.96 |
| 主要消费 | 13 | 18.31 | 4140.58 | 62.87 | 4.23 |
| 医药卫生 | 9 | 16.67 | 2246.17 | 47.03 | 2.29 |
| 金融地产 | 58 | 54.72 | 46436.68 | 95.93 | 47.43 |
| 信息技术 | 7 | 13.73 | 1294.26 | 34.74 | 1.32 |
| 电信业务 | 2 | 13.33 | 799.78 | 56.21 | 0.82 |
| 公用事业 | 8 | 16.33 | 2397.20 | 49.54 | 2.45 |

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 | 16 | 40.00 | 1415.09 | 6.25 | 5.73 |
| 原材料 | 58 | 34.32 | 3148.65 | 28.90 | 12.75 |
| 资本品 | 81 | 46.82 | 5401.53 | 37.53 | 21.88 |
| 商业服务与商业用品 | 5 | 62.50 | 260.85 | 66.33 | 1.06 |
| 运输 | 32 | 62.75 | 2647.11 | 44.46 | 10.72 |
| 汽车与汽车零部件 | 17 | 43.59 | 905.30 | 24.43 | 3.67 |
| 耐用消费品与服装 | 15 | 30.61 | 822.13 | 33.65 | 3.33 |
| 消费者服务 | 4 | 26.67 | 212.78 | 19.81 | 0.86 |
| 媒体 | 7 | 50.00 | 589.92 | 39.45 | 2.39 |
| 零售业 | 23 | 52.27 | 1107.26 | 66.28 | 4.48 |
| 食品与主要用品零售 | 5 | 35.71 | 421.00 | 28.66 | 1.71 |
| 食品、饮料与烟草 | 19 | 35.85 | 1004.25 | 20.95 | 4.07 |
| 家庭与个人用品 | 1 | 25.00 | 36.60 | 11.34 | 0.15 |
| 医疗保健设备与服务 | 1 | 33.33 | 129.76 | 57.87 | 0.53 |
| 制药、生物科技和生 | 29 | 56.86 | 1883.73 | 41.39 | 7.63 |
| 房地产 | 15 | 20.27 | 753.05 | 16.03 | 3.05 |
| 软件与服务 | 9 | 50.00 | 695.68 | 44.76 | 2.82 |
| 技术硬件与设备 | 8 | 36.36 | 450.70 | 29.08 | 1.83 |
| 半导体产品与设备 | 7 | 63.64 | 442.46 | 71.20 | 1.79 |
| 通信设备 | 5 | 35.71 | 360.44 | 48.84 | 1.46 |
| 公用事业 | 23 | 46.94 | 2003.60 | 41.41 | 8.11 |

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 | 41 | 23740.33 | 22748.84 |
| 原材料 | 176 | 12420.32 | 10972.69 |
| 工业 | 247 | 24001.59 | 20919.92 |
| 可选消费 | 174 | 13156.09 | 10509.43 |
| 主要消费 | 74 | 7397.60 | 6610.11 |
| 医药卫生 | 56 | 5226.52 | 4783.51 |
| 金融地产 | 111 | 51193.39 | 48499.24 |
| 信息技术 | 54 | 4563.08 | 3751.74 |
| 电信业务 | 17 | 1521.28 | 1438.54 |
| 公用事业 | 51 | 6201.09 | 4852.82 |

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% |
|--------|------|-------|--------|------|--------|
| 600383 | 金地集团 | 28.47 | 600596 | 新安股份 | -26.88 |
| 600893 | 航空动力 | 24.12 | 600162 | 香江控股 | -20.55 |
| 600372 | 中航电子 | 20.78 | 600108 | 亚盛集团 | -20.38 |
| 600373 | 中文传媒 | 20.07 | 601633 | 长城汽车 | -19.76 |
| 601958 | 金钼股份 | 15.85 | 601117 | 中国化学 | -16.24 |
| 600157 | 永泰能源 | 15.59 | 600067 | 冠城大通 | -15.51 |
| 600094 | 大名城 | 15.19 | 600620 | 天宸股份 | -13.84 |
| 600886 | 国投电力 | 14.22 | 601992 | 金隅股份 | -13.14 |
| 600150 | 中国船舶 | 13.84 | 600684 | 珠江实业 | -11.54 |
| 600259 | 广晟有色 | 13.24 | 600809 | 山西汾酒 | -11.44 |

上证 50 指数

| 代码 | 简称 | 涨幅% | 代码 | 简称 | 跌幅% |
|--------|------|-------|--------|------|--------|
| 600383 | 金地集团 | 28.47 | 601117 | 中国化学 | -16.24 |
| 601601 | 中国太保 | 12.59 | 600010 | 包钢股份 | -9.71 |
| 600104 | 上汽集团 | 10.47 | 600031 | 三一重工 | -9.35 |
| 600030 | 中信证券 | 8.83 | 601118 | 海南橡胶 | -8.63 |
| 600028 | 中国石化 | 7.95 | 600518 | 康美药业 | -7.72 |
| 600050 | 中国联通 | 7.23 | 600887 | 伊利股份 | -7.56 |
| 601169 | 北京银行 | 6.19 | 600547 | 山东黄金 | -7.53 |
| 601318 | 中国平安 | 5.94 | 600018 | 上港集团 | -6.32 |
| 601398 | 工商银行 | 5.67 | 600406 | 国电南瑞 | -4.88 |
| 601166 | 兴业银行 | 5.36 | 600089 | 特变电工 | -4.37 |

上证 380 指数

| 代码 | 简称 | 涨幅% | 代码 | 简称 | 跌幅% |
|--------|------|--------|--------|------|--------|
| 600317 | 营口港 | 113.39 | 600096 | 云天化 | -21.89 |
| 600756 | 浪潮软件 | 93.76 | 600708 | 海博股份 | -21.59 |
| 600139 | 西部资源 | 69.33 | 600171 | 上海贝岭 | -20.68 |
| 601231 | 环旭电子 | 61.91 | 600587 | 新华医疗 | -20.00 |
| 600790 | 轻纺城 | 60.10 | 600246 | 万通地产 | -19.12 |
| 600410 | 华胜天成 | 51.46 | 600835 | 上海机电 | -19.02 |
| 600285 | 羚锐制药 | 48.75 | 601700 | 风范股份 | -17.51 |
| 600343 | 航天动力 | 47.54 | 600780 | 通宝能源 | -17.27 |
| 600081 | 东风科技 | 46.06 | 601717 | 郑煤机 | -17.21 |
| 600432 | 吉恩镍业 | 42.77 | 600388 | 龙净环保 | -16.32 |

上证综指

| 代码 | 简称 | 涨幅% | 代码 | 简称 | 跌幅% |
|--------|------|--------|--------|--------|--------|
| 600234 | 山水文化 | 117.85 | 600890 | 中房股份 | -30.44 |
| 600317 | 营口港 | 113.39 | 600075 | *ST 新业 | -29.05 |
| 600756 | 浪潮软件 | 93.76 | 600596 | 新安股份 | -26.88 |
| 600052 | 浙江广厦 | 82.01 | 600145 | *ST 国创 | -23.50 |
| 600074 | 中达股份 | 81.05 | 600096 | 云天化 | -21.89 |
| 600652 | 爱使股份 | 72.48 | 600708 | 海博股份 | -21.59 |
| 600139 | 西部资源 | 69.33 | 600371 | 万向德农 | -20.70 |
| 601011 | 宝泰隆 | 65.10 | 600171 | 上海贝岭 | -20.68 |
| 601231 | 环旭电子 | 61.91 | 600162 | 香江控股 | -20.55 |
| 600790 | 轻纺城 | 60.10 | 600108 | 亚盛集团 | -20.38 |

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) |
|--------|------|-----------|--------|------|-----------|
| 601318 | 中国平安 | 690.27 | 600000 | 浦发银行 | 63.06 |
| 600030 | 中信证券 | 628.94 | 600030 | 中信证券 | 54.35 |
| 600000 | 浦发银行 | 609.83 | 600050 | 中国联通 | 54.17 |
| 601166 | 兴业银行 | 491.31 | 601166 | 兴业银行 | 49.06 |
| 600158 | 中体产业 | 382.67 | 601668 | 中国建筑 | 48.92 |
| 600109 | 国金证券 | 367.17 | 600016 | 民生银行 | 47.11 |
| 600016 | 民生银行 | 357.49 | 601818 | 光大银行 | 46.53 |
| 600887 | 伊利股份 | 340.95 | 601288 | 农业银行 | 43.37 |
| 600837 | 海通证券 | 314.92 | 600048 | 保利地产 | 41.96 |
| 600036 | 招商银行 | 278.31 | 601901 | 方正证券 | 36.94 |

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) |
|--------|------|-----------|--------|------|-----------|
| 601318 | 中国平安 | 690.27 | 600000 | 浦发银行 | 63.06 |
| 600030 | 中信证券 | 628.94 | 600030 | 中信证券 | 54.35 |
| 600000 | 浦发银行 | 609.83 | 600050 | 中国联通 | 54.17 |
| 601166 | 兴业银行 | 491.31 | 601166 | 兴业银行 | 49.06 |
| 600016 | 民生银行 | 357.49 | 601668 | 中国建筑 | 48.92 |
| 600887 | 伊利股份 | 340.95 | 600016 | 民生银行 | 47.11 |
| 600837 | 海通证券 | 314.92 | 601818 | 光大银行 | 46.53 |
| 600036 | 招商银行 | 278.31 | 601288 | 农业银行 | 43.37 |
| 600048 | 保利地产 | 270.47 | 600048 | 保利地产 | 41.96 |
| 600383 | 金地集团 | 254.88 | 601901 | 方正证券 | 36.94 |

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) |
|--------|------|-----------|--------|------|-----------|
| 600756 | 浪潮软件 | 299.52 | 601000 | 唐山港 | 55.72 |
| 601000 | 唐山港 | 267.17 | 600317 | 营口港 | 30.95 |
| 600545 | 新疆城建 | 259.85 | 600545 | 新疆城建 | 30.37 |
| 600536 | 中国软件 | 248.88 | 600425 | 青松建化 | 23.50 |
| 600432 | 吉恩镍业 | 230.44 | 600688 | 上海石化 | 22.40 |
| 600570 | 恒生电子 | 180.78 | 601018 | 宁波港 | 20.27 |
| 600037 | 歌华有线 | 165.80 | 600575 | 芜湖港 | 16.56 |
| 600410 | 华胜天成 | 162.65 | 600432 | 吉恩镍业 | 16.52 |
| 600343 | 航天动力 | 146.45 | 600410 | 华胜天成 | 16.49 |
| 600522 | 中天科技 | 142.86 | 601618 | 中国中冶 | 16.07 |

上证综指

| 代码 | 简称 | 成交金额 (亿元) | 代码 | 简称 | 成交股数 (亿股) |
|--------|------|-----------|--------|------|-----------|
| 601318 | 中国平安 | 690.27 | 600000 | 浦发银行 | 63.06 |
| 600030 | 中信证券 | 628.94 | 601000 | 唐山港 | 55.72 |
| 600000 | 浦发银行 | 609.83 | 600030 | 中信证券 | 54.35 |
| 601166 | 兴业银行 | 491.31 | 600050 | 中国联通 | 54.17 |
| 600158 | 中体产业 | 382.67 | 601166 | 兴业银行 | 49.06 |
| 600109 | 国金证券 | 367.17 | 601668 | 中国建筑 | 48.92 |
| 600016 | 民生银行 | 357.49 | 600016 | 民生银行 | 47.11 |
| 600149 | 廊坊发展 | 341.04 | 601818 | 光大银行 | 46.53 |
| 600887 | 伊利股份 | 340.95 | 601288 | 农业银行 | 43.37 |
| 600837 | 海通证券 | 314.92 | 600048 | 保利地产 | 41.96 |

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 | 12208.92 | 能源 | 62.17 | 17.14 | 58.18 | 12.17 |
| 601398 | 工商银行 | 8969.79 | 金融地产 | 24.00 | 12.59 | 18.82 | 8.94 |
| 601288 | 农业银行 | 7410.19 | 金融地产 | 19.83 | 10.40 | 15.55 | 7.38 |
| 600028 | 中国石化 | 4810.56 | 能源 | 24.50 | 6.75 | 22.92 | 4.79 |
| 601628 | 中国人寿 | 2834.08 | 金融地产 | 7.58 | 3.98 | 5.95 | 2.82 |
| 601088 | 中国神华 | 2397.80 | 能源 | 12.21 | 3.37 | 11.43 | 2.39 |
| 600036 | 招商银行 | 2112.40 | 金融地产 | 5.65 | 2.97 | 4.43 | 2.10 |
| 601166 | 兴业银行 | 1910.95 | 金融地产 | 5.11 | 2.68 | 4.01 | 1.90 |
| 601318 | 中国平安 | 1882.97 | 金融地产 | 5.04 | 2.64 | 3.95 | 1.88 |
| 600104 | 上汽集团 | 1686.91 | 可选消费 | 65.80 | 2.37 | 32.08 | 1.68 |

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% |
|--------|------|-----------|-----------|------------------|----------------|
| 601727 | 上海电气 | 378.27 | 资本品 | 6.81 | 1.49 |
| 601898 | 中煤能源 | 368.83 | 能源 | 25.39 | 1.45 |
| 601991 | 大唐发电 | 355.80 | 公用事业 | 17.32 | 1.40 |
| 601018 | 宁波港 | 290.56 | 运输 | 10.80 | 1.14 |
| 601111 | 中国国航 | 280.38 | 运输 | 10.42 | 1.10 |
| 601618 | 中国中冶 | 277.69 | 资本品 | 5.00 | 1.09 |
| 601158 | 重庆水务 | 237.12 | 公用事业 | 11.54 | 0.93 |
| 601877 | 正泰电器 | 220.91 | 资本品 | 3.98 | 0.87 |
| 600998 | 九州通 | 215.53 | 食品与主要用品零售 | 46.63 | 0.85 |
| 600377 | 宁沪高速 | 211.39 | 运输 | 7.86 | 0.83 |

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 | 12208.92 | 12208.92 | 能源 |
| 601398 | 工商银行 | 8969.79 | 8969.79 | 金融地产 |
| 601288 | 农业银行 | 7410.19 | 7160.92 | 金融地产 |
| 601988 | 中国银行 | 4991.43 | 4991.43 | 金融地产 |
| 600028 | 中国石化 | 4810.56 | 4810.56 | 能源 |
| 601628 | 中国人寿 | 2834.08 | 2834.08 | 金融地产 |
| 601088 | 中国神华 | 2397.80 | 2397.80 | 能源 |
| 600036 | 招商银行 | 2112.40 | 2112.40 | 金融地产 |
| 601166 | 兴业银行 | 1910.95 | 1622.82 | 金融地产 |
| 601318 | 中国平安 | 1882.97 | 1882.97 | 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 亿元以下 | 7 | 1.49 | 257.25 | 1.89 |
| 50~100 亿元 | 23 | 9.62 | 1794.74 | 10.57 |
| 100~500 亿 | 112 | 55.72 | 27283.64 | 65.02 |
| 500~1000 亿 | 17 | 94.44 | 11281.10 | 95.70 |
| 1000~5000 亿 | 18 | 100.00 | 35801.22 | 100.00 |
| 5000 亿元以上 | 3 | 100.00 | 28588.91 | 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 | 20 | 9.95 | 6938.60 | 16.54 |
| 500~1000 亿 | 12 | 66.67 | 8447.34 | 71.66 |
| 1000~5000 亿 | 15 | 83.33 | 28421.14 | 79.39 |
| 5000 亿元以上 | 3 | 100.00 | 28588.91 | 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 亿元以下 | 38 | 14.56 | 957.88 | 16.98 |
| 30~50 亿 | 105 | 50.48 | 4124.40 | 51.63 |
| 50~100 亿 | 163 | 68.20 | 11502.49 | 67.72 |
| 100~200 亿 | 57 | 49.57 | 7729.02 | 48.28 |
| 200~500 亿 | 17 | 19.77 | 4782.04 | 18.43 |
| 500 亿元以上 | 0 | 0.00 | 0.00 | 0.00 |

| 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 | 310 | 6087.80 | 5723.51 |
| 30~50 亿 | 211 | 8104.07 | 7276.37 |
| 50~100 亿 | 239 | 16984.73 | 14508.01 |
| 100~200 亿 | 116 | 16113.95 | 13471.27 |
| 200~500 亿 | 86 | 25952.91 | 21809.76 |
| 500 亿元以上 | 39 | 76177.82 | 72297.92 |

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 (2014.06.30) | 季度涨跌% |
|--------------------|---------|---------|------------|---------|------------|-----------------|-------|
| 上证 180 系列 | | | | | | | |
| 000010 | 上证 180 | 5037.80 | 2014-04-10 | 4596.45 | 2014-05-21 | 4729.21 | 0.74 |
| 000016 | 上证 50 | 1587.62 | 2014-04-10 | 1447.94 | 2014-05-21 | 1482.41 | 1.13 |
| 000018 | 180 金融 | 3014.36 | 2014-04-10 | 2749.00 | 2014-05-21 | 2820.23 | 1.97 |
| 000021 | 180 治理 | 587.29 | 2014-04-10 | 537.28 | 2014-05-21 | 552.91 | 1.27 |
| 000025 | 180 基建 | 1076.07 | 2014-04-11 | 1000.44 | 2014-04-29 | 1017.39 | 0.27 |
| 000026 | 180 资源 | 2135.40 | 2014-04-10 | 1952.86 | 2014-05-08 | 2044.10 | 1.37 |
| 000027 | 180 运输 | 739.49 | 2014-04-11 | 660.50 | 2014-06-25 | 669.19 | -5.65 |
| 000043 | 超大盘 | 1474.67 | 2014-04-11 | 1334.42 | 2014-05-21 | 1360.35 | 0.14 |
| 000044 | 上证中盘 | 2285.07 | 2014-04-10 | 2084.85 | 2014-05-21 | 2165.50 | 0.09 |
| 000050 | 50 等权 | 1518.92 | 2014-04-10 | 1389.07 | 2014-05-21 | 1416.68 | 0.04 |
| 000054 | 上证海外 | 750.80 | 2014-04-10 | 681.92 | 2014-05-21 | 703.13 | 1.94 |
| 上证 180 风格指数 | | | | | | | |
| 000028 | 180 成长 | 1910.68 | 2014-04-10 | 1737.54 | 2014-05-21 | 1790.30 | -0.08 |
| 000029 | 180 价值 | 2162.76 | 2014-04-10 | 1995.27 | 2014-05-21 | 2048.11 | 1.71 |
| 000030 | 180R 成长 | 1347.13 | 2014-04-10 | 1215.94 | 2014-05-21 | 1256.91 | -0.37 |
| 000031 | 180R 价值 | 1720.85 | 2014-04-10 | 1582.50 | 2014-05-21 | 1623.17 | 1.61 |
| 上证规模指数 | | | | | | | |
| 000009 | 上证 380 | 3496.84 | 2014-04-14 | 3196.83 | 2014-05-21 | 3367.91 | 1.34 |
| 000045 | 上证小盘 | 3011.08 | 2014-04-14 | 2752.47 | 2014-05-21 | 2890.89 | 1.10 |
| 000046 | 上证中小 | 2615.82 | 2014-04-10 | 2391.46 | 2014-05-21 | 2497.96 | 0.60 |
| 000047 | 上证全指 | 2020.38 | 2014-04-10 | 1845.49 | 2014-05-21 | 1909.44 | 0.84 |
| 上证全指风格指数 | | | | | | | |
| 000057 | 全指成长 | 2180.62 | 2014-04-10 | 1990.93 | 2014-05-21 | 2054.32 | 0.55 |
| 000058 | 全指价值 | 2118.39 | 2014-04-10 | 1954.47 | 2014-05-21 | 2000.96 | 0.99 |
| 000059 | 全 R 成长 | 1973.93 | 2014-04-10 | 1787.04 | 2014-05-21 | 1862.50 | 0.40 |
| 000060 | 全 R 价值 | 2035.06 | 2014-04-10 | 1872.67 | 2014-05-21 | 1925.71 | 1.21 |
| 上证行业指数 | | | | | | | |
| 000032 | 上证能源 | 1453.94 | 2014-04-10 | 1320.17 | 2014-05-05 | 1373.64 | 0.15 |
| 000033 | 上证材料 | 1423.07 | 2014-04-10 | 1269.89 | 2014-06-19 | 1318.78 | -1.66 |
| 000034 | 上证工业 | 1391.00 | 2014-04-10 | 1260.84 | 2014-06-25 | 1295.39 | -1.45 |
| 000035 | 上证可选 | 2070.99 | 2014-04-14 | 1856.41 | 2014-05-21 | 1922.07 | -1.02 |
| 000036 | 上证消费 | 4393.78 | 2014-04-11 | 3778.19 | 2014-06-20 | 3929.94 | -2.58 |
| 000037 | 上证医药 | 4274.41 | 2014-04-11 | 3810.87 | 2014-05-21 | 4142.88 | 0.28 |
| 000038 | 上证金融 | 2858.18 | 2014-04-10 | 2617.16 | 2014-05-21 | 2688.54 | 2.22 |
| 000039 | 上证信息 | 2564.77 | 2014-04-15 | 2248.95 | 2014-05-19 | 2553.13 | 8.64 |
| 000040 | 上证电信 | 1834.34 | 2014-04-18 | 1616.77 | 2014-04-29 | 1771.44 | 4.24 |
| 000041 | 上证公用 | 1514.04 | 2014-04-10 | 1419.56 | 2014-04-29 | 1460.03 | 1.43 |

| 代码 | 简称 | 最高 (日期) | 最低 (日期) | 收盘 (2014.06.30) | 季度涨跌% |
|-----------------------|--------|--------------------|---------------------|-----------------|-------|
| 上证行业策略指数 | | | | | |
| 000070 | 能源等权 | 2278.75 2014-05-13 | 2024.50 2014-04-29 | 2118.41 | 1.19 |
| 000071 | 材料等权 | 2000.40 2014-04-10 | 1832.18 2014-04-29 | 1919.14 | 0.95 |
| 000072 | 工业等权 | 1755.25 2014-04-10 | 1582.24 2014-06-19 | 1631.18 | -1.76 |
| 000073 | 可选等权 | 2202.50 2014-04-14 | 1980.74 2014-06-19 | 2071.09 | -0.36 |
| 000074 | 消费等权 | 4069.78 2014-04-11 | 3569.68 2014-06-20 | 3718.06 | -3.46 |
| 000075 | 医药等权 | 5576.07 2014-04-15 | 4999.33 2014-05-21 | 5420.86 | 0.66 |
| 000076 | 金融等权 | 2855.09 2014-04-10 | 2626.85 2014-05-21 | 2694.92 | 1.54 |
| 000077 | 信息等权 | 3217.43 2014-06-30 | 2805.73 2014-05-19 | 3213.50 | 10.17 |
| 000078 | 电信等权 | 1560.29 2014-04-18 | 1423.11 2014-04-29 | 1538.32 | 5.00 |
| 000079 | 公用等权 | 1762.16 2014-04-10 | 1625.76 2014-06-19 | 1669.90 | -0.65 |
| 上证央企、民企、国企主题指数 | | | | | |
| 000042 | 上证央企 | 948.17 2014-04-10 | 877.84 2014-05-21 | 911.25 | 2.95 |
| 000049 | 上证民企 | 1114.49 2014-04-10 | 998.88 2014-05-21 | 1040.32 | -1.70 |
| 000055 | 上证地企 | 728.44 2014-04-10 | 659.02 2014-06-04 | 670.97 | -0.87 |
| 000056 | 上证国企 | 640.86 2014-04-10 | 588.10 2014-05-21 | 604.43 | 1.23 |
| 上证其他主题指数 | | | | | |
| 000015 | 红利指数 | 1702.35 2014-04-10 | 1591.88 2014-05-21 | 1620.50 | 0.27 |
| 000048 | 责任指数 | 793.69 2014-04-10 | 723.90 2014-05-21 | 748.11 | 1.30 |
| 000062 | 上证沪企 | 1555.60 2014-04-10 | 1430.98 2014-05-21 | 1466.18 | 0.35 |
| 000063 | 上证周期 | 1949.90 2014-04-10 | 1787.05 2014-05-21 | 1829.32 | 1.72 |
| 000064 | 非周期 | 1727.10 2014-04-11 | 1559.89 2014-06-19 | 1617.39 | -0.42 |
| 000065 | 上证龙头 | 2001.18 2014-04-10 | 1848.54 2014-04-01 | 1923.40 | 3.81 |
| 000066 | 上证商品 | 1353.72 2014-04-10 | 1225.20 2014-06-19 | 1271.72 | -1.38 |
| 000067 | 上证新兴 | 4706.69 2014-04-10 | 4215.29 2014-05-21 | 4518.62 | 1.77 |
| 000068 | 上证资源 | 1609.95 2014-05-13 | 1472.38 2014-05-05 | 1548.56 | 1.15 |
| 000069 | 消费 80 | 2693.70 2014-04-14 | 2409.27 2014-05-21 | 2507.57 | -0.80 |
| 上证综合类指数 | | | | | |
| 000001 | 上证指数 | 2146.67 2014-04-10 | 1991.06 2014-05-21 | 2048.33 | 0.74 |
| 000002 | A 股指数 | 2247.69 2014-04-10 | 2084.44 2014-05-21 | 2144.75 | 0.75 |
| 000003 | B 股指数 | 232.85 2014-04-11 | 216.85 2014-06-25 | 221.27 | -1.65 |
| 000004 | 工业指数 | 1782.58 2014-04-10 | 1641.19 2014-05-21 | 1708.06 | 1.01 |
| 000005 | 商业指数 | 2627.78 2014-04-14 | 2357.26 2014-06-20 | 2456.27 | -0.73 |
| 000006 | 地产指数 | 3419.83 2014-04-25 | 3084.93 2014-06-25 | 3150.73 | -0.25 |
| 000007 | 公用指数 | 3515.75 2014-04-10 | 3267.35 2014-04-29 | 3323.33 | -0.88 |
| 000008 | 综合指数 | 1870.58 2014-04-10 | 1742.80 2014-05-21 | 1779.43 | 0.86 |
| 000017 | 新综指 | 1812.58 2014-04-10 | 1680.84 2014-05-21 | 1729.41 | 0.74 |
| 000020 | 中型综指 | 898.35 2014-04-14 | 818.54 2014-04-29 | 883.65 | 3.96 |
| 000090 | 上证流通 | 735.36 2014-04-10 | 672.25 2014-05-21 | 699.22 | 1.19 |
| 上证行业指数固定收益指数 | | | | | |
| 000012 | 国债指数 | 142.13 2014-06-30 | 140.27 2014-04-14 | 142.02 | 1.05 |
| 000013 | 企债指数 | 172.91 2014-06-30 | 168.78 2014-04-01 | 172.82 | 2.40 |
| 000022 | 沪公司债 | 150.96 2014-06-30 | 147.29 2014-04-01 | 150.90 | 2.44 |
| 000023 | 沪分离债 | 147.64 2014-06-30 | 143.37 2014-04-01 | 147.60 | 2.88 |
| 000061 | 沪企债 30 | 127.64 2014-06-30 | 124.33 2014-04-03 | 127.64 | 2.28 |
| 上证基金类指数 | | | | | |
| 000011 | 基金指数 | 3949.53 2014-02-20 | 3624.314 2014-03-21 | 3694.30 | -4.79 |

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 | 华夏上证50ETF | 上海证券交易所 | 510050 | 211.32 |
| 上证180指数 | 华安上证180ETF | 上海证券交易所 | 510180 | 121.70 |
| 上证红利指数 | 华泰柏瑞上证红利ETF | 上海证券交易所 | 510880 | 10.70 |
| 上证50指数 | 野村上证50ETF | 大阪证券交易所 | 1309.0 | -- |
| 上证50指数 | 标智上证50ETF | 香港交易所 | 3024.HK | -- |
| 上证央企50指数 | 工银瑞信上证中央企业50ETF | 上海证券交易所 | 510060 | 4.58 |
| 上证180公司治理指数 | 交银施罗德上证180公司治理ETF | 上海证券交易所 | 510010 | 17.86 |
| 上证50指数 | 大华上证50中国挂牌基金 | 新加坡交易所 | USSE50.SP | -- |
| 上证超级大盘指数 | 博时上证超大盘ETF | 上海证券交易所 | 510020 | 6.36 |
| 上证中盘指数 | 易方达上证中盘ETF | 上海证券交易所 | 510130 | 6.16 |
| 上证180价值指数 | 华宝兴业上证180价值ETF | 上海证券交易所 | 510030 | 7.94 |
| 上证社会责任指数 | 建信上证社会责任ETF | 上海证券交易所 | 510090 | 2.95 |
| 上证民企50指数 | 鹏华上证民企50ETF | 上海证券交易所 | 510070 | 2.17 |
| 上证周期行业50指数 | 海富通上证周期行业50ETF | 上海证券交易所 | 510110 | 1.55 |
| 上证龙头企业指数 | 华安上证龙头企业ETF | 上海证券交易所 | 510190 | 4.51 |
| 上证大宗商品股票指数 | 国联上证大宗商品ETF | 上海证券交易所 | 510170 | 2.55 |
| 上证50指数 | 标智上证50中国指数基金 | 台湾证券交易所 | 008201.TW | -- |
| 上证消费80指数 | 招商上证消费80ETF | 上海证券交易所 | 510150 | 7.26 |
| 上证中小盘指数 | 华泰柏瑞上证中小盘ETF | 上海证券交易所 | 510220 | 0.61 |
| 上证综指 | 富国上证综指ETF | 上海证券交易所 | 510210 | 2.61 |
| 上证180金融指数 | 国泰上证180金融ETF | 上海证券交易所 | 510230 | 14.85 |
| 上证新兴产业指数 | 诺安上证新兴产业ETF | 上海证券交易所 | 510260 | 3.88 |
| 上证非周期行业100指数 | 海富通上证非周期行业100ETF | 上海证券交易所 | 510120 | 1.63 |
| 上证国企100指数 | 中银上证国企100ETF | 上海证券交易所 | 510270 | 0.50 |
| 上证180成长指数 | 华宝兴业上证180成长ETF | 上海证券交易所 | 510280 | 2.43 |
| 上证380指数 | 南方上证380ETF | 上海证券交易所 | 510290 | 1.78 |
| 上证180指数 | 富邦上证180ETF | 台湾证券交易所 | 006205.TW | -- |
| 上证自然资源指数 | 博时上证自然资源ETF | 上海证券交易所 | 510410 | 1.56 |
| 上证50指数 | 元大宝来上证50ETF | 台湾证券交易所 | -- | -- |
| 上证180等权重指数 | 景顺长城上证180等权重ETF | 上海证券交易所 | 510420 | 0.83 |
| 上证50等权重指数 | 银华上证50等权重ETF | 上海证券交易所 | 510430 | 0.30 |
| 上证5年期国债指数 | 国泰上证5年期国债ETF | 上海证券交易所 | 511010 | 5.93 |
| 上证能源指数 | 华夏上证能源发起式ETF | 上海证券交易所 | 510610 | 1.10 |
| 上证原材料指数 | 华夏上证原材料发起式ETF | 上海证券交易所 | 510620 | 1.00 |
| 上证主要消费指数 | 华夏上证主要消费发起式ETF | 上海证券交易所 | 510630 | 3.05 |
| 上证金融地产指数 | 华夏上证金融地产发起式ETF | 上海证券交易所 | 510650 | 2.02 |
| 上证医药卫生指数 | 华夏上证医药卫生发起式ETF | 上海证券交易所 | 510660 | 3.99 |
| 上证市值百强指数 | 长盛上证市值百强ETF | 上海证券交易所 | 510700 | 0.76 |
| 上证180高贝塔指数 | 上投摩根上证180高贝塔ETF | 上海证券交易所 | 510450 | 0.31 |
| 上证企债30指数 | 博时上证企债30ETF | 上海证券交易所 | 511210 | 10.95 |
| 上证380指数 | 万家上证380ETF | 上海证券交易所 | 510680 | 0.50 |
| 指数基金 | | | | |
| 上证A股指数 | 景福证券投资基金 | -- | 184701 | 27.61 |
| 上证180指数 | 万家180指数证券投资基金 | -- | 519180 | 27.82 |
| 上证50指数 | 易方达50指数证券投资基金 | -- | 110003 | 124.67 |
| 上证综合指数 | 汇添富上证综合指数证券投资基金 | -- | 470007 | 36.44 |
| 上证50指数 | 中海上证50指数增强型证券投资基金 | -- | 399001 | 1.56 |
| 上证380指数 | 中海上证380指数基金 | -- | 399011 | 0.19 |
| 上证380指数 | 中邮上证380指数增强型证券投资基金 | -- | 590007 | 0.22 |

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。

$$\text{算法: } \text{ROTA} = \frac{TNP}{TA} = \frac{\sum(NP_i \times TN_i / PN_i)}{\sum(TA_i \times TN_i / PN_i)}$$

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。

$$\text{算法: } \text{ROE} = \frac{TNP}{TNA} = \frac{\sum(NP_i \times TN_i / PN_i)}{\sum(NA_i \times TN_i / PN_i)}$$

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

$$\text{算法: } \text{ROR} = \frac{TPR}{TA} = \frac{\sum(PR_i \times TN_i / PN_i)}{\sum(TA_i \times TN_i / PN_i)}$$

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

$$\text{算法: } \text{ROD} = \frac{\sum(TA_i - PR_i) \times TN_i / PN_i}{\sum(TA_i \times TN_i / PN_i)}$$

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