

上证指数季报

2014年7-9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（2014.7-2014.9）	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9月30日）和三季度涨跌幅

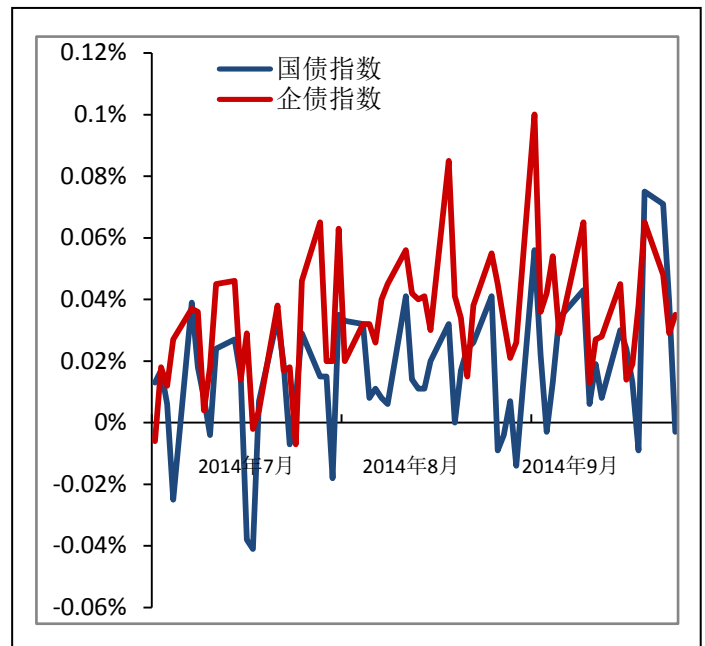
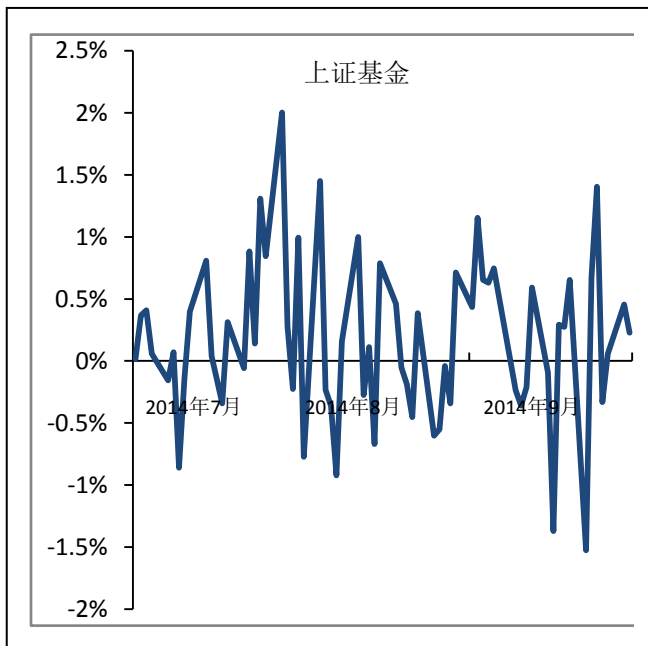
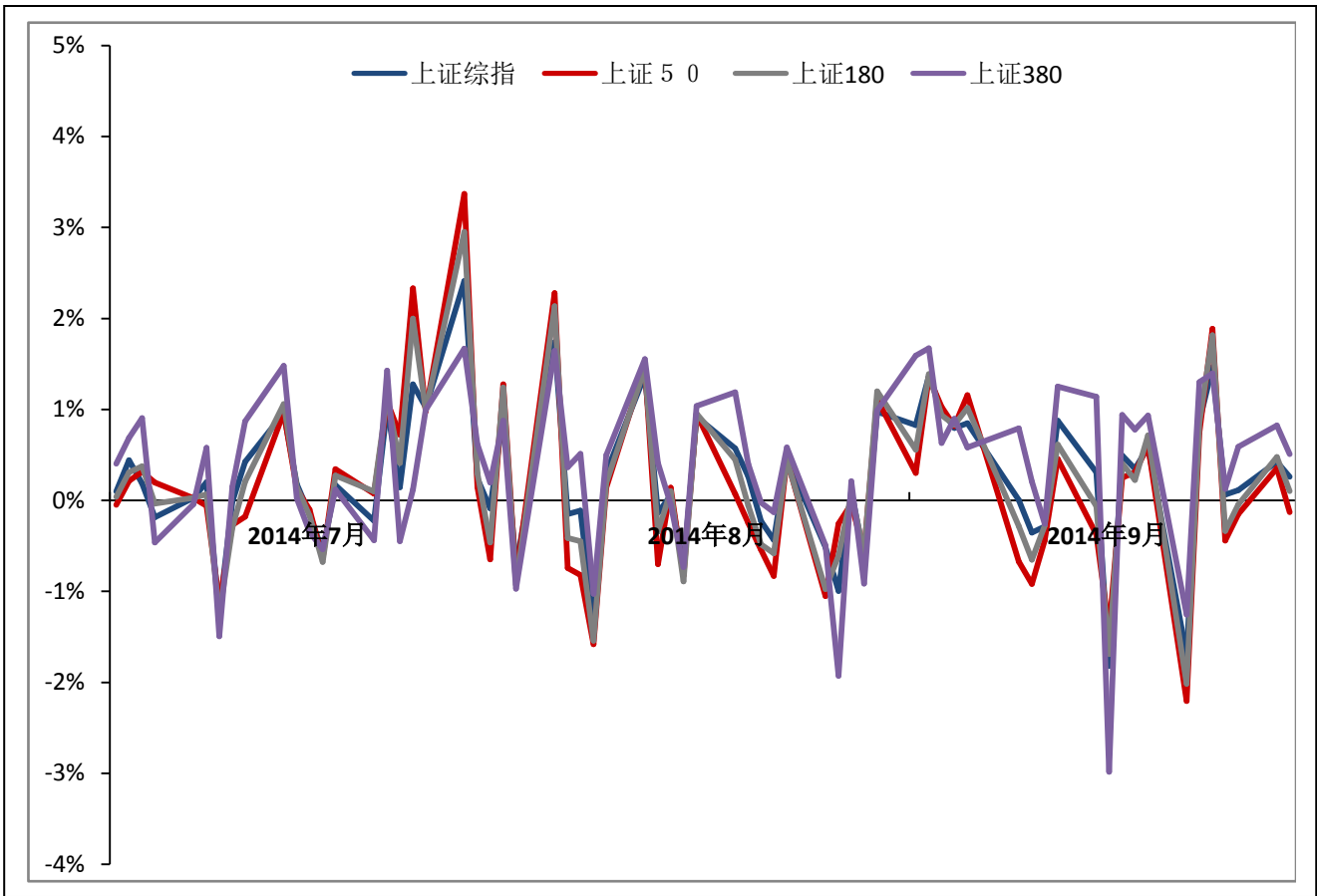
上证180指数	5341.614	12.95%	上证企债指数	176.761	2.28%
上证50指数	1619.697	9.26%	上证国债指数	143.597	1.11%
上证380指数	4189.904	24.41%	上证基金指数	4175.702	11.13%
上证综指指数	2363.87	15.41%			

本季度180指数与上证综指的日收益率相关系数为97.18%，显示了较强的市场代表性。9月30日，上证180指数成份股的流通市值占上海A股市场的70%，总市值占67%，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78.22%，流通市值占上海A股市场的20%，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0.72元、0.8元和0.3元。9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8.45倍、7.44倍和24.69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8.85倍、8.03倍和22.9倍。

本季度上证中型综指和上证信息等权重指数涨幅分别为28.29%和26.101%，在沪市A股指数体系中涨幅居前。

上证指数季度走势 (2014.7-2014.9)

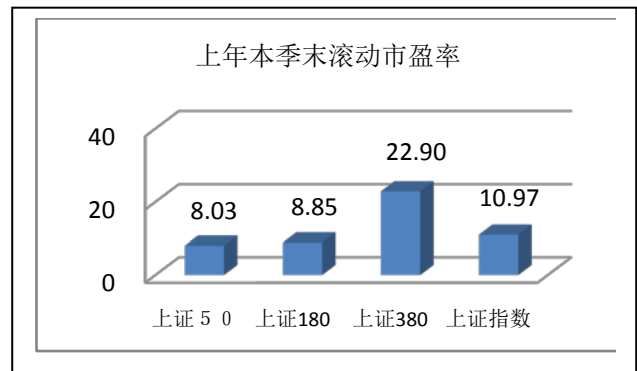
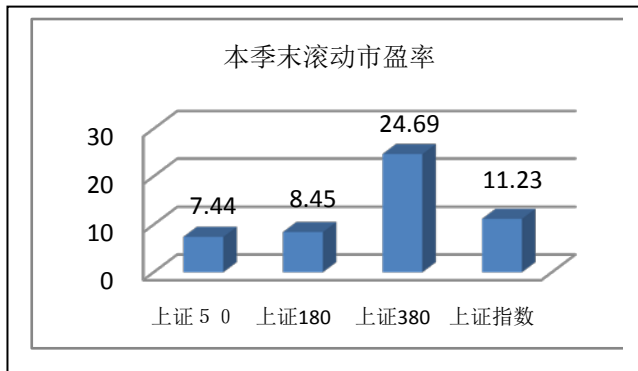


指数基本资料

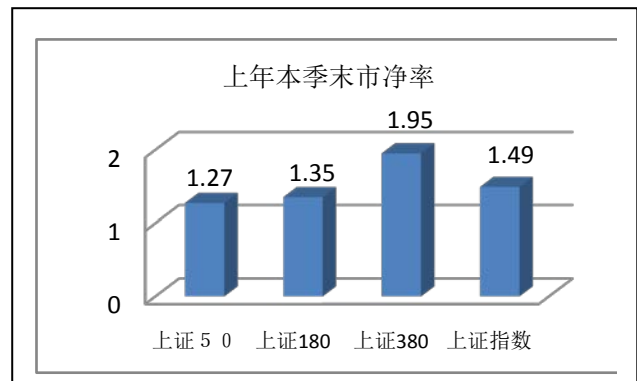
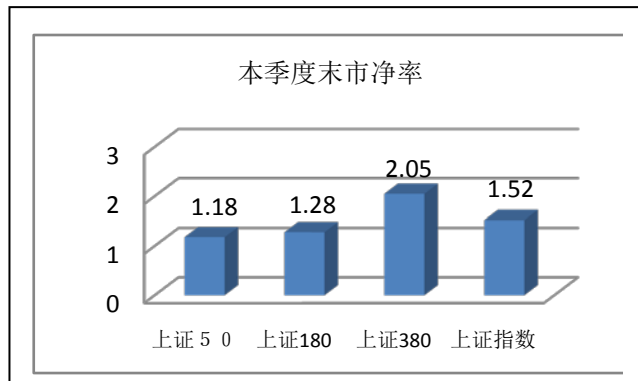
一、上证指数收益率和波动率

	累计收益%					日收益标准差%				
	7月	8月	9月	季度	上年本季	7月	8月	9月	季度	上年本季
上证50	9.41	-2.50	2.43	9.26	5.84	0.96	0.92	0.94	0.96	1.64
上证180	9.01	-0.93	4.59	12.95	8.87	0.87	0.88	0.90	0.90	1.46
上证380	7.55	3.08	12.21	24.41	20.83	0.74	0.90	1.02	0.90	1.30
上证指数	7.48	0.71	6.62	15.41	9.88	0.71	0.76	0.82	0.77	1.13

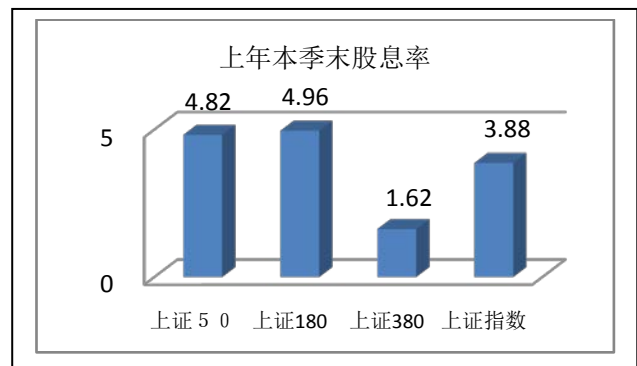
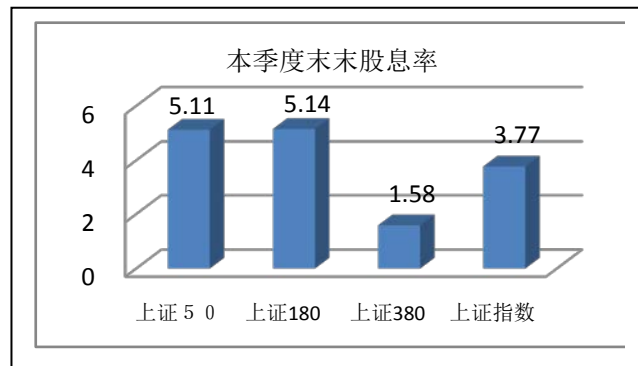
二、上证指数市盈率



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)	7.78	11.66	3.67	17.61
指数总市值覆盖率%	44.00	67.00	21.00	100.00
指数流通市值 (万亿元)	7.46	10.88	3.15	15.73
指数流通市值覆盖率%	48.00	70.00	20.00	100.00
样本股日均成交额 (亿元)	4.83	3.24	1.19	1.32
换手率%	15.16	24.08	87.61	43.18
指数日收益相关系数	98.37	100.00	78.22	97.18

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)	10448.55	13770.49	1436.35	15244.28
股东权益 (亿元)	65672.37	90777.84	17863.28	115760.31
每股收益 (元)	0.80	0.72	0.30	0.57
每股净资产 (元)	5.03	4.75	3.72	4.32
净资产收益率%	15.91	15.17	8.04	13.17
股东权益比率%	9.90	10.41	33.33	12.19
资产负债比率%	90.10	89.59	66.67	87.81
资产报酬率%	1.57	1.58	2.68	1.60

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	20286.04	83.91	27.18
原材料	4	2.35	1684.54	12.47	2.26
工业	10	4.26	6933.21	25.64	9.29
可选消费	4	2.44	2615.30	19.32	3.50
主要消费	3	4.05	2982.78	37.44	4.00
医药卫生	2	3.64	651.39	11.86	0.87
金融地产	21	19.81	38380.47	73.17	51.43
金融地产	1	1.89	334.43	7.27	0.45
电信业务	1	6.67	758.84	45.13	1.02

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	21841.57	90.34	20.07
原材料	21	12.35	6001.89	44.44	5.51
工业	32	13.62	11958.68	44.23	10.99
可选消费	19	11.59	6347.96	46.89	5.83
主要消费	13	17.57	4831.06	60.63	4.44
医药卫生	9	16.36	2422.99	44.13	2.23
金融地产	58	54.72	50011.31	95.34	45.95
信息技术	7	13.21	1505.83	32.74	1.38
电信业务	2	13.33	911.58	54.22	0.84
公用事业	8	15.38	3003.00	49.34	2.76

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	1903.93	7.87	6.05
原材料	58	34.12	3965.49	29.36	12.59
资本品	81	46.29	7272.53	38.58	23.09
商业服务与商业用品	5	55.56	345.00	66.08	1.10
运输	32	62.75	3495.89	45.59	11.10
汽车与汽车零部件	17	41.46	1188.44	22.69	3.77
耐用消费品与服装	15	30.61	1031.54	33.95	3.28
消费者服务	4	25.00	246.91	19.95	0.78
媒体	7	50.00	753.48	39.73	2.39
零售业	23	52.27	1394.94	65.51	4.43
食品与主要用品零售	5	35.71	527.20	29.39	1.67
食品、饮料与烟草	19	33.93	1200.87	20.57	3.81
家庭与个人用品	1	25.00	43.68	12.95	0.14
医疗保健设备与服务	1	33.33	130.23	51.41	0.41
制药、生物科技和生	29	55.77	2209.25	42.18	7.02
房地产	15	20.27	921.38	15.79	2.93
软件与服务	9	50.00	910.15	47.92	2.89
技术硬件与设备	8	34.78	527.83	28.47	1.68
半导体产品与设备	7	58.33	576.39	68.19	1.83
通信设备	5	35.71	415.12	45.00	1.32
公用事业	23	44.23	2429.78	39.92	7.72

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	25422.64	24315.95
原材料	177	15584.55	13599.37
工业	250	31311.87	27258.70
可选消费	177	16275.39	13685.22
主要消费	77	9036.43	7995.85
医药卫生	57	6045.87	5501.06
金融地产	111	55558.07	52560.24
信息技术	56	5849.74	4627.07
电信业务	17	2980.34	1699.78
公用事业	54	8059.23	6103.55

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%
600765	中航重机	117.50	600079	人福医药	-7.10
600157	永泰能源	105.91	600383	金地集团	-5.06
600435	北方导航	102.45	600196	复星医药	-4.32
600150	中国船舶	72.91	600352	浙江龙盛	-3.90
600316	洪都航空	58.82	600315	上海家化	-2.05
600010	包钢股份	54.42	600600	青岛啤酒	-1.29
601099	太平洋	54.32	600703	三安光电	-0.29
600108	亚盛集团	52.44			
600674	川投能源	52.15			
600633	浙报传媒	51.62			

上证 50 指数

代码	简称	涨幅%	代码	简称	跌幅%
600010	包钢股份	54.42	600383	金地集团	-5.06
601118	海南橡胶	36.77	600196	复星医药	-4.32
601989	中国重工	36.10	600703	三安光电	-0.29
600406	国电南瑞	28.51			
601117	中国化学	27.48			
600104	上汽集团	26.80			
600256	广汇能源	25.50			
601006	大秦铁路	23.30			
601169	北京银行	22.26			
601688	华泰证券	21.28			

上证380指数

代码	简称	涨幅%	代码	简称	跌幅%
600666	西南药业	131.87	600776	东方通信	-22.11
600965	福成五丰	107.86	600285	羚锐制药	-8.80
600317	营口港	105.15	600594	益佰制药	-8.55
600850	华东电脑	97.09	600790	轻纺城	-5.23
603766	隆鑫通用	90.16	600557	康缘药业	-4.49
601106	中国一重	88.02	600389	江山股份	-1.44
601718	际华集团	72.66	600329	中新药业	-1.41
601608	中信重工	69.08	600312	平高电气	-0.96
600210	紫江企业	66.88	600638	新黄浦	-0.48
600990	四创电子	65.85			

上证综指

代码	简称	涨幅%	代码	简称	跌幅%
603126	中材节能	318.50	600776	东方通信	-22.11
603168	莎普爱思	278.76	600285	羚锐制药	-8.80
603099	长白山	254.85	600594	益佰制药	-8.55
603009	北特科技	247.65	600079	人福医药	-7.10
603111	康尼机电	232.37	600149	廊坊发展	-5.52
600715	松辽汽车	206.70	600790	轻纺城	-5.23
601579	会稽山	202.03	601011	宝泰隆	-5.15
600490	鹏欣资源	178.89	600383	金地集团	-5.06
600212	江泉实业	145.71	600330	天通股份	-4.89
600399	抚顺特钢	134.11	600557	康缘药业	-4.49

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)
600030	中信证券	965.37	600157	永泰能源	165.68
601318	中国平安	959.41	600010	宝钢股份	117.52
600157	永泰能源	752.28	601989	中国重工	105.92
600435	北方导航	702.06	601328	交通银行	86.97
600000	浦发银行	680.39	601668	中国建筑	83.73
601166	兴业银行	664.18	601818	光大银行	82.66
601989	中国重工	582.46	600048	保利地产	79.33
600111	宝钢稀土	581.66	601288	农业银行	77.55
600633	浙报传媒	548.20	600030	中信证券	76.06
600010	宝钢股份	541.79	600016	民生银行	75.07

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	965.37	600010	包钢股份	117.52
601318	中国平安	959.41	601989	中国重工	105.92
600000	浦发银行	680.39	601328	交通银行	86.97
601166	兴业银行	664.18	601668	中国建筑	83.73
601989	中国重工	582.46	601818	光大银行	82.66
600111	包钢稀土	581.66	600048	保利地产	79.33
600010	包钢股份	541.79	601288	农业银行	77.55
600837	海通证券	503.57	600030	中信证券	76.06
600256	广汇能源	494.34	600016	民生银行	75.07
600887	伊利股份	482.91	600000	浦发银行	71.10

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	463.46	600317	营口港	105.59
600879	航天电子	440.33	601618	中国中冶	78.79
600317	营口港	395.91	601106	中国一重	60.43
600536	中国软件	334.43	601018	宁波港	60.09
600343	航天动力	305.46	601880	大连港	49.74
600410	华胜天成	304.01	600863	内蒙华电	44.56
600391	成发科技	257.46	601918	国投新集	42.93
600405	动力源	242.21	600688	上海石化	39.80
600677	航天通信	240.94	601000	唐山港	38.57
600119	长江投资	214.34	601718	际华集团	37.84

上证综指

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	965.37	600157	永泰能源	165.68
601318	中国平安	959.41	600010	包钢股份	117.52
600157	永泰能源	752.28	601989	中国重工	105.92
600435	北方导航	702.06	600317	营口港	105.59
600000	浦发银行	680.39	601328	交通银行	86.97
601166	兴业银行	664.18	601668	中国建筑	83.73
601989	中国重工	582.46	601818	光大银行	82.66
600111	包钢稀土	581.66	600048	保利地产	79.33
600633	浙报传媒	548.20	601618	中国中冶	78.79
600010	包钢股份	541.79	601288	农业银行	77.55

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	12613.73	能源	62.16	16.48	57.55	11.31
601398	工商银行	9340.76	金融地产	23.60	12.20	18.19	8.38
601288	农业银行	7321.98	金融地产	18.50	9.56	14.26	6.57
600028	中国石化	4837.95	能源	23.84	6.32	22.07	4.34
601628	中国人寿	3238.06	金融地产	8.18	4.23	6.31	2.90
601088	中国神华	2566.01	能源	12.64	3.35	11.71	2.30
600036	招商银行	2143.35	金融地产	5.41	2.80	4.17	1.92
600104	上汽集团	1993.42	可选消费	67.45	2.60	29.28	1.79
601318	中国平安	1978.70	金融地产	5.00	2.58	3.85	1.77
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	533.91	资本品	7.13	1.64
601018	宁波港	435.20	运输	12.22	1.34
601898	中煤能源	429.23	能源	22.19	1.32
601618	中国中冶	422.21	资本品	5.64	1.30
601991	大唐发电	408.77	公用事业	16.11	1.26
601111	中国国航	340.03	运输	9.54	1.04
601158	重庆水务	302.40	公用事业	11.92	0.93
600027	华电国际	285.73	公用事业	11.26	0.88
600998	九州通	278.50	食品与主要用品零售	47.64	0.86
600188	兖州煤业	262.85	能源	13.59	0.81

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	12613.73	12613.73	能源
601398	工商银行	9340.76	9340.76	金融地产
601288	农业银行	7321.98	7075.67	金融地产
601988	中国银行	5285.04	5285.04	金融地产
600028	中国石化	4837.95	4837.95	能源
601628	中国人寿	3238.06	3238.06	金融地产
601088	中国神华	2566.01	2566.01	能源
600036	招商银行	2143.35	2143.35	金融地产
600104	上汽集团	1993.42	1671.03	可选消费
601318	中国平安	1978.70	1978.70	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	5	1.34	227.57	1.82
50~100 亿元	12	4.55	960.92	5.15
100~500 亿	113	41.54	28005.56	51.96
500~1000 亿	26	89.66	16211.26	91.03
1000~5000 亿	20	95.24	36665.35	96.81
5000 亿元以上	4	100.00	34561.51	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	15	5.51	5437.58	10.09
500~1000 亿	14	48.28	9157.72	51.42
1000~5000 亿	18	85.71	33913.35	89.54
5000 亿元以上	3	75.00	29276.47	84.71

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	10	6.85	267.06	7.60
30~50 亿	76	33.33	3101.63	34.43
50~100 亿	177	67.05	12737.83	68.28
100~200 亿	89	51.74	12045.01	50.78
200~500 亿	26	26.00	7483.18	24.80
500 亿元以上	2	3.70	1035.75	1.15

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	194	4010.34	3783.40
30~50 亿	231	9128.39	8579.14
50~100 亿	265	18705.81	16245.51
100~200 亿	173	23858.38	19067.16
200~500 亿	100	30176.99	26746.69
500 亿元以上	54	90244.22	82924.89

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. 09. 30)	季度涨跌%		
上证 180 系列							
000010	上证 180	5370.60	2014-09-25	4670.59	2014-07-11	5341.61	12.95
000016	上证 50	1660.01	2014-09-09	1460.91	2014-07-11	1619.70	9.26
000018	180 金融	3133.39	2014-08-04	2754.86	2014-07-18	3039.64	7.78
000021	180 治理	624.07	2014-09-09	546.85	2014-07-11	616.81	11.56
000025	180 基建	1223.63	2014-09-30	1014.10	2014-07-01	1222.41	20.15
000026	180 资源	2377.35	2014-09-09	2016.20	2014-07-21	2328.67	13.92
000027	180 运输	816.63	2014-09-25	664.72	2014-07-10	810.74	21.15
000043	超大盘	1564.56	2014-09-09	1350.48	2014-07-11	1527.65	12.30
000044	上证中盘	2592.23	2014-09-30	2143.93	2014-07-10	2588.63	19.54
000050	50 等权	1607.60	2014-09-11	1402.27	2014-07-11	1595.25	12.61
000054	上证海外	777.64	2014-08-05	689.52	2014-07-18	751.12	6.83
上证 180 风格指数							
000028	180 成长	1990.79	2014-09-09	1755.07	2014-07-11	1956.12	9.26
000029	180 价值	2280.71	2014-09-09	2021.77	2014-07-11	2227.91	8.78
000030	180R 成长	1441.44	2014-09-25	1237.65	2014-07-11	1436.81	14.31
000031	180R 价值	1836.73	2014-09-09	1606.29	2014-07-11	1817.78	11.99
上证规模指数							
000009	上证 380	4194.71	2014-09-30	3356.58	2014-07-01	4189.90	24.41
000045	上证小盘	3609.19	2014-09-30	2883.61	2014-07-01	3605.38	24.72
000046	上证中小	3056.13	2014-09-30	2492.80	2014-07-01	3052.63	22.21
000047	上证全指	2221.37	2014-09-30	1895.88	2014-07-11	2218.70	16.20
上证全指风格指数							
000057	全指成长	2291.18	2014-09-09	2024.71	2014-07-11	2273.16	10.65
000058	全指价值	2255.12	2014-09-09	1982.77	2014-07-11	2236.96	11.79
000059	全 R 成长	2167.97	2014-09-30	1846.14	2014-07-11	2165.57	16.27
000060	全 R 价值	2239.21	2014-09-30	1914.80	2014-07-11	2236.32	16.13
上证行业指数							
000032	上证能源	1610.94	2014-09-30	1337.76	2014-07-22	1595.78	16.17
000033	上证材料	1576.88	2014-09-16	1307.84	2014-07-10	1571.60	19.17
000034	上证工业	1613.17	2014-09-29	1288.04	2014-07-01	1609.33	24.24
000035	上证可选	2293.01	2014-09-16	1905.85	2014-07-10	2279.19	18.58
000036	上证消费	4566.63	2014-09-30	3842.75	2014-07-10	4557.20	15.96
000037	上证医药	4546.62	2014-09-30	4046.45	2014-07-17	4542.66	9.65
000038	上证金融	2988.17	2014-08-04	2633.95	2014-07-18	2869.85	6.74
000039	上证信息	3154.78	2014-09-30	2463.59	2014-07-24	3153.00	23.50
000040	上证电信	2160.29	2014-09-30	1744.18	2014-07-24	2144.42	21.06
000041	上证公用	1810.50	2014-09-30	1452.60	2014-07-01	1808.52	23.87

代码	简称	最高 (日期)	最低 (日期)	收盘 (2014.09.30)	季度涨跌%
上证行业策略指数					
000070	能源等权	2678.03	2092.14	2633.75	24.33
000071	材料等权	2359.56	1907.91	2354.68	22.70
000072	工业等权	2053.38	1621.55	2049.45	25.64
000073	可选等权	2529.10	2057.69	2525.58	21.94
000074	消费等权	4479.93	3674.43	4470.51	20.24
000075	医药等权	6139.16	5403.95	6137.30	13.22
000076	金融等权	2992.69	2644.81	2942.86	9.20
000077	信息等权	4053.73	3159.33	4052.25	26.10
000078	电信等权	1864.31	1529.23	1852.77	20.44
000079	公用等权	2102.22	1663.13	2097.31	25.59
上证央企、民企、国企主题指数					
000042	上证央企	1034.05	898.48	1028.34	12.85
000049	上证民企	1180.11	1022.14	1178.06	13.24
000055	上证地企	765.86	663.95	757.20	12.85
000056	上证国企	686.49	597.17	682.10	12.85
上证其他主题指数					
000015	红利指数	1834.53	1596.66	1832.83	13.10
000048	责任指数	837.14	739.28	824.19	10.17
000062	上证沪企	1694.44	1443.99	1692.31	15.42
000063	上证周期	2037.58	1801.58	1975.65	8.00
000064	非周期	1907.34	1598.48	1904.66	17.76
000065	上证龙头	2194.23	1893.66	2189.42	13.83
000066	上证商品	1554.59	1261.75	1543.70	21.39
000067	上证新兴	5578.37	4493.59	5550.29	22.83
000068	上证资源	1876.74	1536.71	1865.25	20.45
000069	消费 80	2879.14	2460.24	2871.74	14.52
上证综合类指数					
000001	上证指数	2365.49	2033.00	2363.87	15.41
000002	A 股指数	2476.32	2128.46	2474.59	15.38
000003	B 股指数	268.22	220.86	268.17	21.19
000004	工业指数	2019.63	1701.29	2017.72	18.13
000005	商业指数	3029.54	2433.28	3025.57	23.18
000006	地产指数	3669.72	3121.24	3589.27	13.92
000007	公用指数	4108.35	3312.27	4102.47	23.44
000008	综合指数	1965.38	1749.94	1954.08	9.82
000017	新综指	1996.56	1716.19	1995.16	15.37
000020	中型综指	1134.02	882.71	1133.62	28.29
000090	上证流通	829.73	695.71	828.88	18.54
上证行业指数固定收益指数					
000012	国债指数	143.63	142.00	143.60	1.11
000013	企债指数	176.78	172.79	176.76	2.28
000022	沪公司债	153.95	150.79	153.94	2.01
000023	沪分离债	150.70	147.43	150.06	1.67
000061	沪企债 30	129.81	127.33	129.77	1.66
上证基金类指数					
000011	基金指数	3949.53	3624.314	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	183.78
上证180指数	华安上证180ETF	上海证券交易所	510180	121.59
上证红利指数	华泰柏瑞上证红利ETF	上海证券交易所	510880	10.91
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	1.43
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	5.07
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	18.10
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	6.66
上证中盘指数	易方达上证中盘ETF	上海证券交易所	510130	6.54
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	8.12
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	2.48
上证民企50指数	鹏华上证民企50ETF	上海证券交易所	510070	2.14
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	1.49
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	4.43
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	2.66
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	8.72
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	0.65
上证综指	富国上证综指ETF	上海证券交易所	510210	2.59
上证180金融指数	国泰上证180金融ETF	上海证券交易所	510230	16.19
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	4.06
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	1.48
上证国企100指数	中银上证国企100ETF	上海证券交易所	510270	0.52
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	2.70
上证380指数	南方上证380ETF	上海证券交易所	510290	2.13
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	1.73
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	0.87
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	0.32
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	3.69
上证能源指数	华夏上证能源发起式ETF	上海证券交易所	510610	0.98
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	0.93
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	3.31
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	2.25
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	4.54
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	0.47
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	0.13
上证企债30指数	博时上证企债30ETF	上海证券交易所	511210	3.36
上证380指数	万家上证380ETF	上海证券交易所	510680	0.12
指数基金				
上证A股指数	景福证券投资基金	--	184701	30.91
上证180指数	万家180指数证券投资基金	--	519180	31.24
上证50指数	易方达50指数证券投资基金	--	110003	129.78
上证综合指数	汇添富上证综合指数证券投资基金	--	470007	39.14
上证50指数	中海上证50指数增强型证券投资基金	--	399001	1.60
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	0.37

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。

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

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。

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

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

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

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

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

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 指数成份股的市值规模分布:

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