

上证指数季报

2014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（2014.10-2014.12）	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（2014年12月31日）和四季度涨跌幅

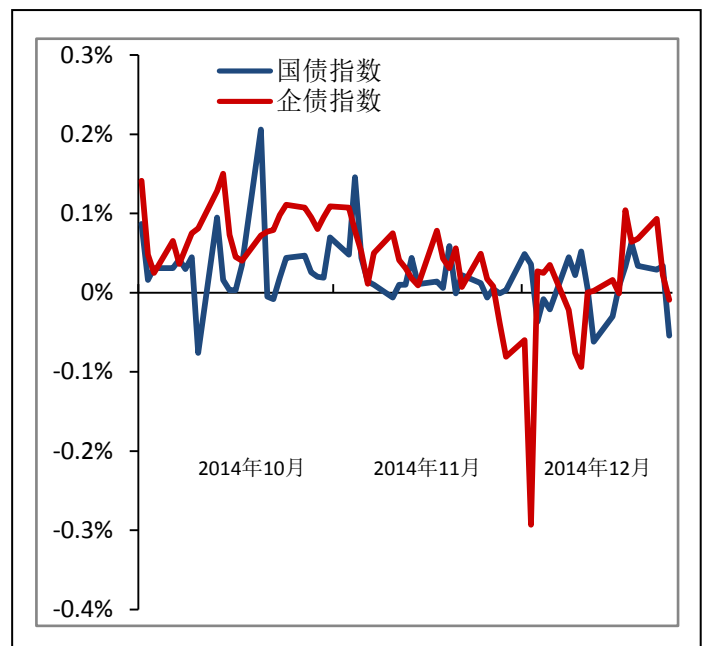
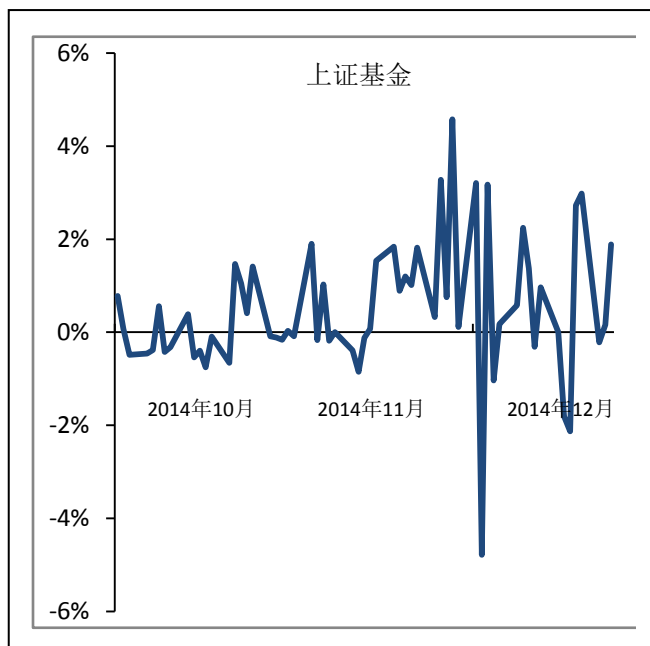
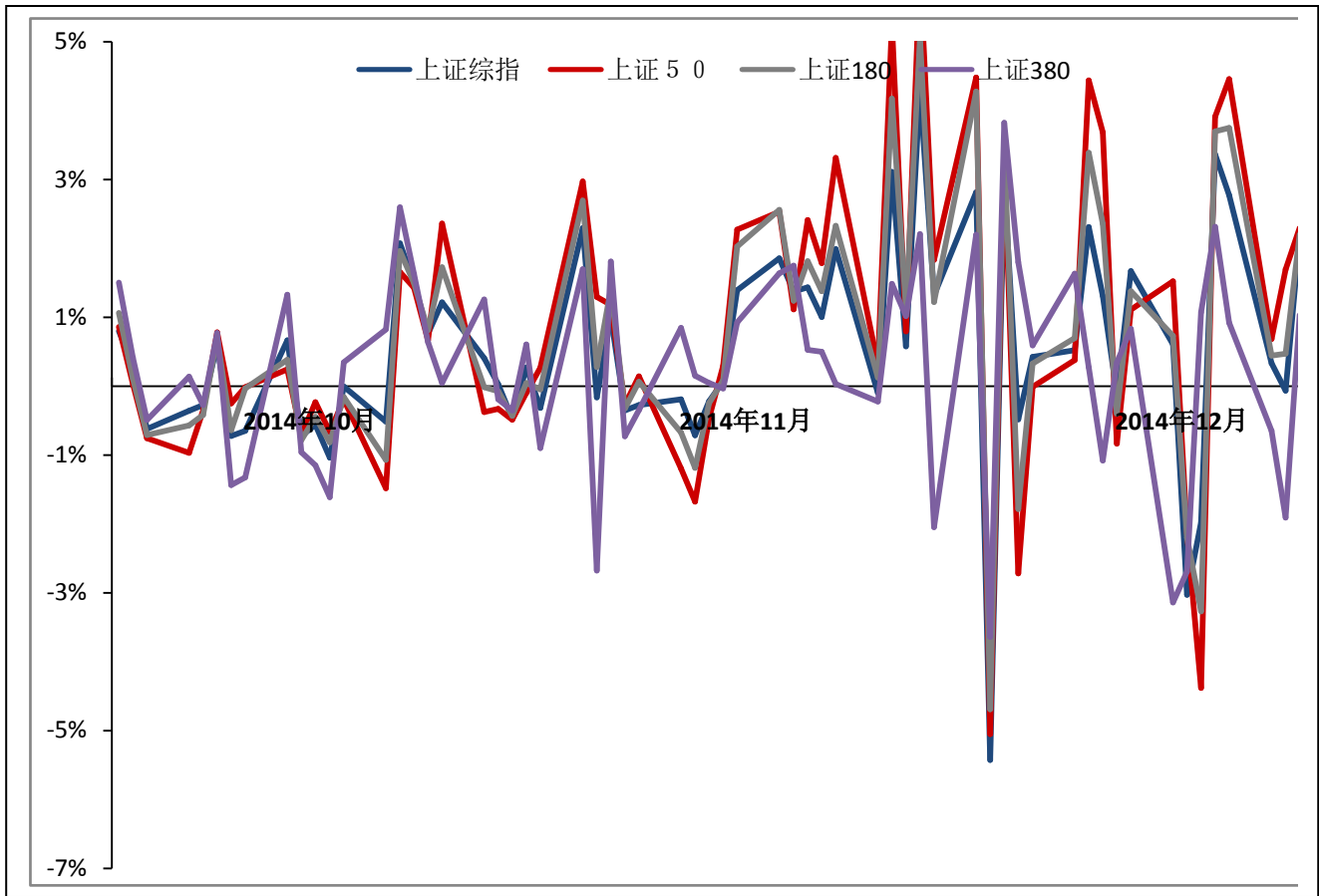
上证180指数	8044.505	50.60%	上证企债指数	181.102	2.46%
上证50指数	2581.567	59.39%	上证国债指数	145.679	1.45%
上证380指数	4866.709	16.15%	上证基金指数	5550.629	32.93%
上证综指指数	3234.677	36.84%			

本季度180指数与上证综指的日收益率相关系数为96.4%，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75%，总市值占72%，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54.61%，流通市值占上海A股市场的17%，总市值占上海A股市场的17%，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0.73元、0.82元和0.3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12.36倍、10.94倍和30.09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8.43倍、7.65倍和20.51倍。

本季度上证金融等权指数涨幅80.31%，上证电信指数跌幅0.45%，在沪市A股指数体系中涨跌幅居前。

上证指数季度走势 (2014.10-2014.12)

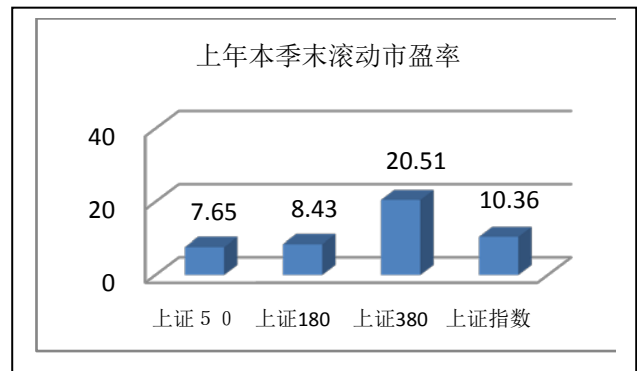
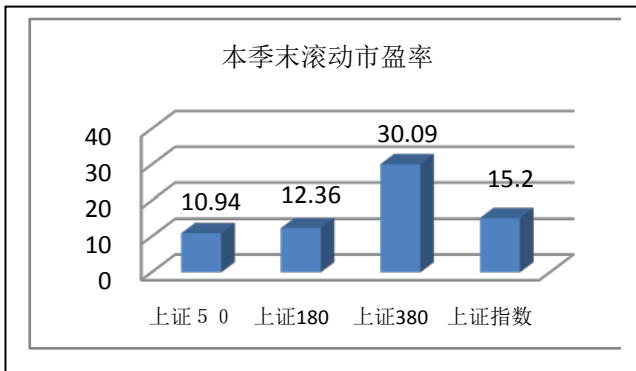


指数基本资料

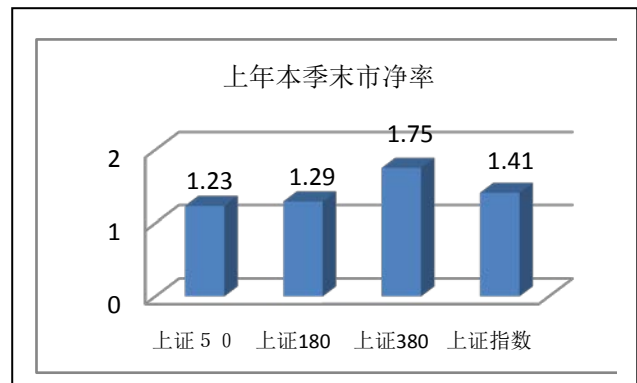
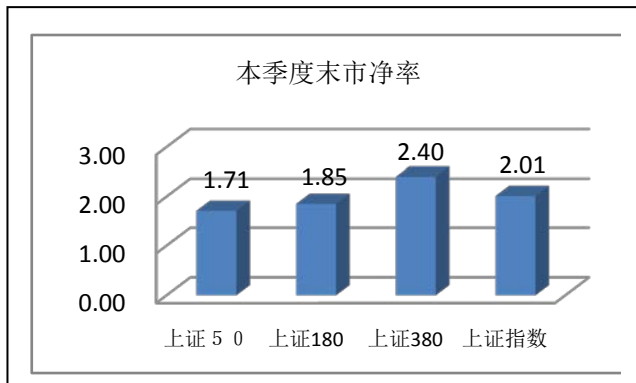
一、上证指数收益率和波动率

	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	2.32	15.52	34.85	59.39	-4.16	0.97	1.40	2.91	2.09	1.20
上证180	2.57	13.59	29.27	50.60	-3.32	0.92	1.14	2.46	1.77	1.14
上证380	2.89	6.62	5.88	16.15	-1.75	1.15	1.06	1.88	1.45	1.37
上证指数	2.38	10.85	20.57	36.84	-2.70	0.87	0.91	2.17	1.53	0.98

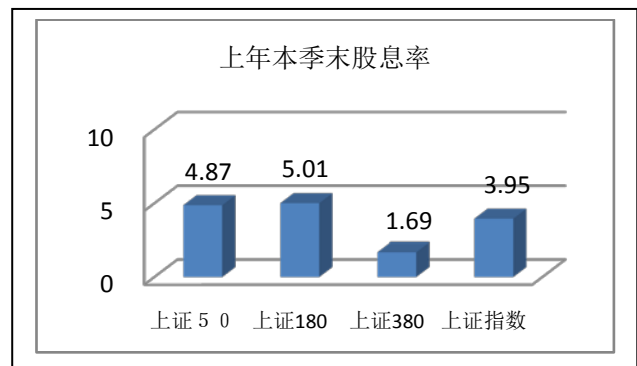
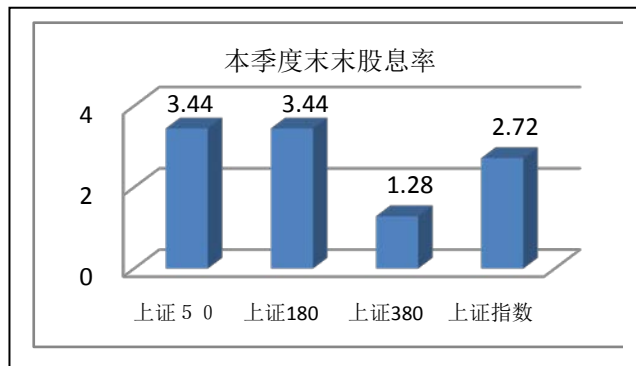
二、上证指数市盈率



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	17.57	4.25	24.40
指数总市值覆盖率%	49.00	72.00	17.00	100.00
指数流通市值 (万亿元)	11.49	16.42	3.65	22.05
指数流通市值覆盖率%	52.00	75.00	17.00	100.00
样本股日均成交额 (亿元)	20.85	10.42	2.15	3.09
换手率%	47.44	63.76	135.97	84.10
指数日收益相关系数	98.00	100.00	54.61	96.40

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)	10861.77	14188.23	1361.36	15607.52
股东权益 (亿元)	69297.01	95110.13	17715.66	120740.73
每股收益 (元)	0.82	0.73	0.30	0.58
每股净资产 (元)	5.22	4.88	3.90	4.46
净资产收益率%	15.67	14.92	7.68	12.93
股东权益比率%	10.12	10.88	34.05	12.69
资产负债比率%	89.88	89.12	65.95	87.31
资产报酬率%	1.59	1.62	2.62	1.64

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	27028.67	85.25	23.53
原材料	3	1.71	1908.30	11.42	1.66
工业	10	4.10	9815.67	25.82	8.54
可选消费	5	3.01	4080.82	26.20	3.55
主要消费	3	4.00	3372.23	38.04	2.94
医药卫生	2	3.51	682.85	12.16	0.59
金融地产	21	19.81	66646.79	75.94	58.01
金融地产	1	1.82	308.01	6.33	0.27
电信业务	1	6.67	1049.23	55.13	0.91

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	10	25.00	28713.41	90.56	17.49
原材料	21	12.00	7845.78	46.96	4.78
工业	34	13.93	19736.76	51.91	12.02
可选消费	20	12.05	7998.41	51.36	4.87
主要消费	13	17.33	5660.91	63.86	3.45
医药卫生	9	15.79	2543.95	45.31	1.55
金融地产	55	51.89	83996.88	95.71	51.16
信息技术	8	14.55	1971.21	40.52	1.20
电信业务	2	13.33	1157.65	60.83	0.71
公用事业	8	15.38	4549.78	52.85	2.77

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	37.50	2348.57	7.41	6.43
原材料	57	32.57	4887.63	29.25	13.38
资本品	82	45.30	8908.12	33.56	24.39
商业服务与商业用品	5	41.67	330.38	55.16	0.90
运输	28	54.90	3909.34	35.94	10.70
汽车与汽车零部件	19	45.24	1317.28	20.98	3.61
耐用消费品与服装	15	30.00	1152.55	35.49	3.16
消费者服务	4	25.00	271.14	19.17	0.74
媒体	5	35.71	455.11	20.98	1.25
零售业	22	50.00	1798.57	73.00	4.92
食品与主要用品零售	4	26.67	327.04	16.38	0.90
食品、饮料与烟草	19	33.93	1351.40	20.70	3.70
家庭与个人用品	1	25.00	45.09	13.34	0.12
医疗保健设备与服务	1	33.33	112.44	48.84	0.31
制药、生物科技和生	30	55.56	2243.38	41.66	6.14
房地产	17	22.97	1351.63	16.01	3.70
软件与服务	8	42.11	717.51	33.35	1.96
技术硬件与设备	11	45.83	605.99	32.33	1.66
半导体产品与设备	8	66.67	590.95	70.46	1.62
通信设备	5	35.71	430.51	50.42	1.18
公用事业	24	46.15	3375.51	39.21	9.24

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	33037.92	31823.26
原材料	182	19270.23	16806.11
工业	259	44300.89	38260.37
可选消费	179	17922.77	15728.10
主要消费	78	10105.28	8896.45
医药卫生	59	6225.72	5624.42
金融地产	111	92426.45	87910.70
信息技术	58	6047.20	4897.58
电信业务	17	3247.86	1919.76
公用事业	54	11389.71	8629.11

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%
601390	中国中铁	197.12	600765	中航重机	-27.01
601800	中国交建	193.04	600640	号百控股	-24.09
601186	中国铁建	191.78	600770	综艺股份	-18.22
601669	中国电建	188.70	600880	博瑞传播	-17.56
601688	华泰证券	168.31	600373	中文传媒	-15.32
600030	中信证券	154.50	600406	国电南瑞	-15.06
600999	招商证券	146.04	603000	人民网	-14.44
601377	兴业证券	135.88	601929	吉视传媒	-12.30
600837	海通证券	133.14	600658	电子城	-10.87
601901	方正证券	129.48	600157	永泰能源	-10.66

上证 50 指数

代码	简称	涨幅%	代码	简称	跌幅%
601688	华泰证券	168.31	600406	国电南瑞	-15.06
600030	中信证券	154.50	600703	三安光电	-7.90
600999	招商证券	146.04	600256	广汇能源	-5.11
600837	海通证券	133.14	600518	康美药业	-1.87
601901	方正证券	129.48			
601628	中国人寿	119.61			
601668	中国建筑	114.75			
600048	保利地产	94.95			
601318	中国平安	80.72			
601998	中信银行	79.30			

上证380指数

代码	简称	涨幅%	代码	简称	跌幅%
600528	中铁二局	154.22	600112	天成控股	-30.27
600185	格力地产	108.53	600666	西南药业	-28.85
600169	太原重工	103.26	600080	金花股份	-28.05
600657	信达地产	100.49	601218	吉鑫科技	-26.11
601111	中国国航	96.49	600776	东方通信	-21.45
600068	葛洲坝	95.60	600387	海越股份	-21.34
600559	老白干酒	90.80	600135	乐凯胶片	-21.16
600415	小商品城	89.97	600965	福成五丰	-21.11
600755	厦门国贸	88.33	600175	美都能源	-20.77
600495	晋西车轴	77.56	600261	阳光照明	-20.67

上证综指

代码	简称	涨幅%	代码	简称	跌幅%
603169	兰石重装	945.83	600070	浙江富润	-36.85
603019	中科曙光	703.97	600605	汇通能源	-34.07
603011	合锻股份	378.17	600822	上海物贸	-33.22
603088	宁波精达	259.51	600247	*ST 成城	-31.66
603166	福达股份	200.34	600112	天成控股	-30.27
601016	节能风电	198.83	600355	精伦电子	-29.93
601788	光大证券	197.29	600666	西南药业	-28.85
601390	中国中铁	197.12	600080	金花股份	-28.05
601800	中国交建	193.04	600370	三房巷	-27.80
601186	中国铁建	191.78	600401	海润光伏	-27.19

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	7297.16	601988	中国银行	479.53
601318	中国平安	4709.02	601668	中国建筑	427.68
600837	海通证券	3899.33	601288	农业银行	393.48
600016	民生银行	3335.58	600016	民生银行	389.59
600000	浦发银行	2774.34	601818	光大银行	385.25
601166	兴业银行	2709.12	600010	包钢股份	321.79
601688	华泰证券	2318.94	600030	中信证券	315.77
601377	兴业证券	2297.58	600795	国电电力	315.58
601668	中国建筑	2234.18	600221	海南航空	286.64
600036	招商银行	2208.80	601989	中国重工	268.77

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	7297.16	601668	中国建筑	427.68
601318	中国平安	4709.02	601288	农业银行	393.48
600837	海通证券	3899.33	600016	民生银行	389.59
600016	民生银行	3335.58	601818	光大银行	385.25
600000	浦发银行	2774.34	600010	包钢股份	321.79
601166	兴业银行	2709.12	600030	中信证券	315.77
601688	华泰证券	2318.94	601989	中国重工	268.77
601668	中国建筑	2234.18	601398	工商银行	229.48
600036	招商银行	2208.80	601328	交通银行	226.17
601989	中国重工	2075.02	600000	浦发银行	223.83

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)
600755	厦门国贸	810.49	601106	中国一重	150.71
601106	中国一重	714.55	600029	南方航空	99.95
601002	晋亿实业	662.84	601333	广深铁路	89.27
600528	中铁二局	602.38	600169	太原重工	84.58
600495	晋西车轴	584.77	600863	内蒙华电	83.54
600068	葛洲坝	553.82	600005	武钢股份	82.69
600169	太原重工	535.18	600755	厦门国贸	81.03
600410	华胜天成	475.66	600068	葛洲坝	80.15
600820	隧道股份	462.92	601111	中国国航	68.64
600029	南方航空	448.49	601718	际华集团	68.32

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	7297.16	601988	中国银行	479.53
601318	中国平安	4709.02	601668	中国建筑	427.68
600837	海通证券	3899.33	601288	农业银行	393.48
600016	民生银行	3335.58	600016	民生银行	389.59
600000	浦发银行	2774.34	601818	光大银行	385.25
601166	兴业银行	2709.12	600010	包钢股份	321.79
601688	华泰证券	2318.94	600030	中信证券	315.77
601377	兴业证券	2297.58	600795	国电电力	315.58
601668	中国建筑	2234.18	600221	海南航空	286.64
600036	招商银行	2208.80	601989	中国重工	268.77

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	17503.78	能源	64.74	14.92	60.81	10.43
601398	工商银行	12891.76	金融地产	18.79	10.99	14.96	7.68
601288	农业银行	10909.45	金融地产	15.90	9.30	12.66	6.50
601628	中国人寿	7111.24	金融地产	10.37	6.06	8.25	4.24
600028	中国石化	5924.21	能源	21.91	5.05	20.58	3.53
601318	中国平安	3575.98	金融地产	5.21	3.05	4.15	2.13
600036	招商银行	3422.34	金融地产	4.99	2.92	3.97	2.04
601088	中国神华	3346.03	能源	12.38	2.85	11.63	1.99
600030	中信证券	3335.28	金融地产	4.86	2.84	3.87	1.99
601166	兴业银行	3143.64	金融地产	4.58	2.68	3.65	1.87

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	812.68	资本品	8.82	2.16
601991	大唐发电	687.61	公用事业	19.96	1.83
601111	中国国航	668.13	运输	16.87	1.77
601898	中煤能源	633.32	能源	26.64	1.68
601158	重庆水务	427.20	公用事业	12.40	1.13
601179	中国西电	398.28	资本品	4.32	1.06
600188	兖州煤业	390.13	能源	16.41	1.04
601106	中国一重	364.82	资本品	3.96	0.97
600029	南方航空	362.37	运输	9.15	0.96
600005	武钢股份	361.36	原材料	7.15	0.96

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	17503.78	17503.78	能源
601398	工商银行	12891.76	12891.76	金融地产
601288	农业银行	10909.45	10542.47	金融地产
601988	中国银行	8130.39	8130.39	金融地产
601628	中国人寿	7111.24	7111.24	金融地产
600028	中国石化	5924.21	5924.21	能源
601318	中国平安	3575.98	3575.98	金融地产
600036	招商银行	3422.34	3422.34	金融地产
601088	中国神华	3346.03	3346.03	能源
600030	中信证券	3335.28	3327.17	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	1	0.29	42.76	0.38
50~100 亿元	7	2.58	614.43	3.27
100~500 亿	100	34.36	26239.58	44.67
500~1000 亿	35	85.37	23496.98	84.45
1000~5000 亿	31	96.88	62810.07	98.02
5000 亿元以上	6	100.00	62470.82	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	11	3.78	4262.89	7.26
500~1000 亿	9	21.95	6096.25	21.91
1000~5000 亿	25	78.13	54074.20	84.39
5000 亿元以上	5	83.33	54340.43	86.99

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	7.09	265.05	8.20
30~50 亿	60	29.56	2492.89	31.30
50~100 亿	160	59.04	11440.82	60.88
100~200 亿	111	60.33	14956.90	59.32
200~500 亿	35	32.71	10509.48	31.35
500 亿元以上	4	5.06	2801.74	1.81

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	189	3772.83	3478.46
30~50 亿	205	8042.96	7292.01
50~100 亿	273	18929.10	16332.59
100~200 亿	185	25330.99	20538.75
200~500 亿	107	33525.82	29272.12
500 亿元以上	79	154372.33	143581.94

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. 12. 31)	季度涨跌%		
上证 180 系列							
000010	上证 180	8067.97	2014-12-31	5147.40	2014-10-27	8044.51	50.60
000016	上证 50	2590.09	2014-12-31	1556.55	2014-10-27	2581.57	59.39
000018	180 金融	5491.03	2014-12-31	2939.77	2014-10-27	5475.36	80.13
000021	180 治理	979.30	2014-12-31	592.81	2014-10-27	975.99	58.23
000025	180 基建	2134.64	2014-12-22	1171.51	2014-10-27	2039.33	66.83
000026	180 资源	2937.11	2014-12-22	2177.34	2014-10-27	2831.98	21.61
000027	180 运输	1130.90	2014-12-09	779.14	2014-10-27	1030.25	27.08
000043	超大盘	2162.12	2014-12-31	1446.56	2014-10-27	2152.67	40.91
000044	上证中盘	3578.22	2014-12-29	2499.34	2014-10-27	3542.06	36.83
000050	50 等权	2359.30	2014-12-31	1536.23	2014-10-27	2351.32	47.40
000054	上证海外	1298.87	2014-12-31	727.80	2014-10-27	1295.14	72.43
上证 180 风格指数							
000028	180 成长	2856.12	2014-12-31	1882.73	2014-10-27	2850.26	45.71
000029	180 价值	3563.63	2014-12-31	2158.99	2014-10-27	3553.59	59.50
000030	180R 成长	2011.83	2014-12-31	1378.99	2014-10-27	2006.72	39.67
000031	180R 价值	2895.30	2014-12-31	1755.21	2014-10-27	2886.14	58.77
上证规模指数							
000009	上证 380	5049.14	2014-12-22	4041.83	2014-10-23	4866.71	16.15
000045	上证小盘	4389.31	2014-12-22	3465.21	2014-10-23	4195.99	16.38
000046	上证中小	3935.62	2014-12-22	2942.35	2014-10-27	3853.58	26.24
000047	上证全指	3124.89	2014-12-31	2139.11	2014-10-27	3118.07	40.54
上证全指风格指数							
000057	全指成长	3209.95	2014-12-31	2195.34	2014-10-27	3204.24	40.96
000058	全指价值	3455.68	2014-12-31	2168.99	2014-10-27	3447.58	54.12
000059	全 R 成长	2810.22	2014-12-29	2079.36	2014-10-27	2791.89	28.92
000060	全 R 价值	3365.98	2014-12-31	2163.52	2014-10-27	3358.03	50.16
上证行业指数							
000032	上证能源	2005.23	2014-12-22	1477.27	2014-10-27	1912.71	19.86
000033	上证材料	2024.92	2014-12-22	1497.44	2014-10-27	1953.58	24.31
000034	上证工业	2588.34	2014-12-22	1572.63	2014-10-27	2439.38	51.58
000035	上证可选	2721.83	2014-12-11	2176.85	2014-10-27	2564.75	12.53
000036	上证消费	5112.84	2014-12-16	4300.47	2014-10-23	5044.88	10.70
000037	上证医药	4925.09	2014-12-16	4462.05	2014-11-11	4607.06	1.42
000038	上证金融	5146.02	2014-12-31	2767.88	2014-10-27	5132.55	78.84
000039	上证信息	3610.26	2014-12-15	2949.61	2014-10-17	3200.74	1.51
000040	上证电信	2315.92	2014-12-09	2030.25	2014-10-23	2134.69	-0.45
000041	上证公用	2619.67	2014-12-29	1709.84	2014-10-27	2548.91	40.94

代码	简称	最高 (日期)	最低 (日期)	收盘 (2014. 12. 31)	季度涨跌%
上证行业策略指数					
000070	能源等权	3230.78	2444.72	3019.42	14.64
000071	材料等权	2886.13	2248.04	2785.38	18.29
000072	工业等权	3236.88	2009.34	3047.32	48.69
000073	可选等权	2862.80	2396.94	2674.96	5.91
000074	消费等权	5062.34	4220.23	4915.80	9.96
000075	医药等权	6753.68	6039.37	6237.71	1.64
000076	金融等权	5319.82	2849.08	5306.21	80.31
000077	信息等权	4546.81	3787.26	4056.48	0.10
000078	电信等权	2202.10	1754.21	2057.20	11.03
000079	公用等权	2839.14	1970.40	2742.48	30.76
上证央企、民企、国企主题指数					
000042	上证央企	1691.45	993.50	1685.09	63.87
000049	上证民企	1467.37	1138.23	1438.57	22.11
000055	上证地企	1118.70	723.25	1111.50	46.79
000056	上证国企	1070.12	656.01	1066.56	56.36
上证其他主题指数					
000015	红利指数	2595.47	1757.28	2547.69	39.00
000048	责任指数	1271.64	797.45	1268.74	53.94
000062	上证沪企	2450.40	1628.95	2440.72	44.22
000063	上证周期	3362.94	1898.47	3354.00	69.77
000064	非周期	2477.78	1829.89	2422.17	27.17
000065	上证龙头	2811.38	2097.18	2806.88	28.20
000066	上证商品	1881.10	1448.07	1808.16	17.13
000067	上证新兴	6430.96	5409.88	6181.04	11.36
000068	上证资源	2295.36	1749.77	2186.51	17.22
000069	消费 80	3271.62	2751.95	3160.71	10.06
上证综合类指数					
000001	上证指数	3239.36	2279.84	3234.68	36.84
000002	A 股指数	3394.32	2386.78	3389.40	36.97
000003	B 股指数	292.64	254.60	290.76	8.43
000004	工业指数	2459.66	1933.64	2418.92	19.88
000005	商业指数	3835.75	2890.23	3751.72	24.00
000006	地产指数	6294.10	3412.12	6234.64	73.70
000007	公用指数	6472.91	3958.51	6158.44	50.12
000008	综合指数	3085.39	1892.90	3071.70	57.19
000017	新综指	2737.28	1924.39	2733.30	37.00
000020	中型综指	1274.71	1093.11	1185.51	4.58
000090	上证流通	1125.26	799.24	1121.35	35.29
上证行业指数固定收益指数					
000012	国债指数	145.78	143.69	145.68	1.45
000013	企债指数	181.54	176.96	181.10	2.46
000022	沪公司债	157.39	154.01	157.11	2.06
000023	沪分离债	153.72	149.05	152.83	1.84
000061	沪企债 30	132.59	128.51	131.31	1.19
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	258.60
上证180指数	华安上证180ETF	上海证券交易所	510180	147.82
上证红利指数	华泰柏瑞上证红利ETF	上海证券交易所	510880	12.85
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	2.29
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	7.95
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	20.26
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	7.83
上证中盘指数	易方达上证中盘ETF	上海证券交易所	510130	7.44
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	13.61
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	2.84
上证民企50指数	鹏华上证民企50ETF	上海证券交易所	510070	1.81
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	2.72
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	3.52
上证大宗商品股票指数	国联安上证大宗商品ETF	上海证券交易所	510170	2.77
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	5.79
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	0.63
上证综指	富国上证综指ETF	上海证券交易所	510210	2.49
上证180金融指数	国泰上证180金融ETF	上海证券交易所	510230	25.88
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	2.98
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	1.12
上证国企100指数	中银上证国企100ETF	上海证券交易所	510270	0.67
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	3.80
上证380指数	南方上证380ETF	上海证券交易所	510290	2.94
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	1.95
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	4.56
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	1.08
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	3.79
上证能源指数	华夏上证能源发起式ETF	上海证券交易所	510610	1.08
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	0.84
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	3.55
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	5.26
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	4.37
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	0.25
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	0.48
上证企债30指数	博时上证企债30ETF	上海证券交易所	511210	1.87
上证380指数	万家上证380ETF	上海证券交易所	510680	0.09
上证可质押城投债指数	海富通上证可质押城投债ETF	上海证券交易所	511220	65.15
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	--	13.45
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	--	3.04
指数基金				
上证180指数	万家180指数证券投资基金	--	519180	38.64
上证50指数	易方达50指数证券投资基金	--	110003	200.81
上证综合指数	汇添富上证综合指数证券投资基金	--	470007	42.96
上证50指数	中海上证50指数增强型证券投资基金	--	399001	2.90
上证380指数	中海上证380指数基金	--	399011	0.23
上证380指数	中邮上证380指数增强型证券投资基金	--	590007	0.58

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。

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

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。

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

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

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

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

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

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