

上海证券交易所创新实验室报告·第 2014001 号

上海证券交易所市场质量报告 (2014)

上海证券交易所金融创新实验室

2014 年 3 月



上海證券交易所
SHANGHAI STOCK EXCHANGE

摘 要

市场质量是衡量证券市场核心竞争力的重要指标，对市场质量指标的关注程度则是市场成熟与否的重要标志。本年度报告披露了上海证券交易所交易市场质量和订单执行质量等有关数据。

2013 年沪市证券交易市场质量处于较好水平，市场质量指数达到 327 点，与 2012 年基本持平。

- (1) 从价格冲击指数来看，2013 年较 2012 年有所下降。交易 10 万元股票的价格冲击成本为例，下降幅度达 16%，流动性成本从整体来看呈现下跌趋势，市场流动性出现较大改善。
- (2) 从流动性指数来看，2013 年沪市流动性指数为 336 万元，比 2012 年的 276 上升了 22%。
- (3) 从买卖价差指标看，2013 年沪市绝对买卖价差与相对买卖价差分别为 1.5 和 19，较 2012 年下降 6.25% 和 5%。
- (4) 从有效价差来看，2013 年沪市股票的绝对有效价差和相对有效价差均与 2012 年相等，分别为 3 和 35。
- (5) 从市场深度来看，订单深度指标达 2006 年以来的最大值，5 档订单深度为 470 万元，10 档订单深度为 850 万元，两档订单深度较 2012 年提高了约 25%，市场流动性较为充沛。
- (6) 从大宗交易成本来看，2013 年买卖 300 万股票的价格冲击指数，分别为 141、99 个基点，比 2012 年分别下降 17% 和 12%。
- (7) 从流动性指标的日内特征来看，2013 年与 2012 年大致相同。
- (8) 从波动性看，2013 年沪市超额波动率和收益波动率与 2012 年基本持平，日内波动率上升 5 个基点。

2013 年订单执行质量较高，继续保持在良好水平。

- (1) 从订单申报金额或订单大小来看，2013 年，沪市平均每笔

申报金额为 3.3 万元，为 2012 年的 96.2%，每笔成交金额 1.6 万元，为 2012 年的 90.4%。申报金额分布中，有 51.38% 的订单申报金额不超过 1 万元（2012 年占比为 53.17%），另有 41.32% 的订单在 1 万与 10 万元之间，6.27% 的订单在十万与五十万元之间，1.03 % 的订单超过 50 万元。订单申报分布趋向于两端增加，平均金额有所下降。

- (2) 从订单申报、成交及撤单笔数来看，2013 年，沪市平均每天的有效报单笔数为 786.07 万笔，成交 481.93 万笔(单向)。虽然平均每天的有效报单笔数小于 2012 年的 832.7 万笔,但成交笔数较 2012 年的 400.9 万笔，提高了 20%，订单成交率出现显著提高。撤单笔数平均每交易日有 190.19 万笔，约占有效报单笔数的 24.29%，撤单笔数占比继续维持在 25% 附近，但较前几年有所下降。
- (3) 从订单成交情况来看，参与申报的账户中 75.41% 有成交，如以数量（股数）计算，全年有 60.1% 的订单得以成交，高于去年水平（2012 年为 59.7%）。从投资者类型的订单成交情况来看，机构投资者提交的订单股数占 14.7%（略低于 2012 年的 15.0%），但成交额占 16.55%（高于 2012 年的 10.8%）。

目 录

摘 要.....	I
目 录.....	III
图表目录.....	IV
一、引 言.....	1
二、证券交易市场质量	2
(一) 流动性与交易成本	2
1、价格冲击指数	2
2、流动性指数.....	5
3、买卖价差.....	8
4、有效价差.....	12
5、订单(市场)深度	15
6、大宗交易成本	18
7、流动性指标的日内特征	21
(二) 波动性	23
(三) 市场质量指数	26
三、订单执行质量	28
四、结论.....	32
附录一 各项指标定义	33
附录二 个股市场质量指标统计(2013)	37

图表目录

图 1 相关年份所有股票价格冲击指数（2013）	单位：基点	3
图 2 买方向与卖方向价格冲击指数（2013）	单位：基点	3
图 3 逐月价格冲击指数（2013）	单位：基点	4
图 4 按板块分组的价格冲击指数（2013）	单位：基点	4
图 5 按流通市值分组的价格冲击指数（2013）	单位：基点	4
图 6 按股价分组的价格冲击指数（2013）	单位：基点	5
图 7 按行业分类的价格冲击指数（2013）	单位：基点	5
图 8 相关年份流动性指数（2013）	单位：万元	6
图 9 逐月流动性指数（2013）	单位：万元	7
图 10 按板块分组的流动性指数（2013）	单位：万元	7
图 11 按流通市值分组的流动性指数（2013）	单位：万元	7
图 12 按股价分组的流动性指数（2013）	单位：万元	8
图 13 按行业分类的流动性指数（2013）	单位：万元	8
图 14 相关年份绝对买卖价差（2013）	单位：分	9
图 15 相关年份相对买卖价差（2013）	单位：基点	9
图 16 逐月绝对买卖价差（2013）	单位：分	10
图 17 逐月相对买卖价差（2013）	单位：基点	10
图 18 按板块分组的相对买卖价差（2013）	单位：基点	10
图 19 按流通市值分组的相对买卖价差（2013）	单位：基点	11
图 20 按股价分组的相对买卖价差（2013）	单位：基点	11
图 21 按行业分类的相对买卖价差（2013）	单位：基点	11
图 22 相关年份绝对有效价差（2013）	单位：分	12
图 23 相关年份相对有效价差（2013）	单位：基点	13
图 24 逐月绝对有效价差（2013）	单位：分	13
图 25 逐月相对有效价差（2013）	单位：基点	13
图 26 按板块分组的相对有效价差（2013）	单位：基点	14
图 27 按流通市值分组的相对有效价差（2013）	单位：基点	14
图 28 按股价分组的相对有效价差（2013）	单位：基点	15

图 29 按行业分类的相对有效价差 (2013)	单位: 基点	15
图 30 相关年份市场订单深度 (2013)	单位: 万元	16
图 31 逐月订单深度 (2013)	单位: 万元	17
图 32 按板块分组的订单深度 (2013)	单位: 万元	17
图 33 按流通市值分组的订单深度 (2013)	单位: 万元	17
图 34 按股价分组的订单深度 (2013)	单位: 万元	18
图 35 按行业分类的订单深度 (2013)	单位: 万元	18
图 36 相关年份大宗交易成本 (2013)	单位: 基点	19
图 37 逐月大宗交易成本 (2013)	单位: 基点	20
图 38 按板块分组的大宗交易成本 (2013)	单位: 基点	20
图 39 按流通市值分组的大宗交易成本 (2013)	单位: 基点	20
图 40 按股价分组的大宗交易成本 (2013)	单位: 基点	21
图 41 按行业分类的大宗交易成本 (2013)	单位: 基点	21
图 42 流动性指标的日内特征 (2013)		22
图 43 相关年份波动率 (2013)	单位: 基点	24
图 44 按板块分组的波动率 (2013)	单位: 基点	24
图 45 按流通市值分组的波动率 (2013)	单位: 基点	24
图 46 按股价分组的波动率 (2013)	单位: 基点	25
图 47 按行业分组的波动率 (2013)	单位: 基点	25
图 48 日内波动走势图 (2013)	单位: 基点	25
图 49 相关年份的市场质量指数 (2013)		26
图 50 按板块分组的市場质量指数 (2013)		26
图 51 按流通市值分组的市場质量指数 (2013)		27
图 52 按股价分组的市場质量指数 (2013)		27
图 53 按行业分类的市場质量指数 (2013)		27
表 1 按申报金额日均订单申报情况 (2013)		29
表 2 各时间段申报笔数、成交笔数、成交金额占比情况 (2013)	单位:%	29
表 3 各订单类型在各证券品种中应用的分布 (2013)	单位:%	30
表 4 订单成交分类统计 (2013)	单位:%	30
表 5 日均订单执行时间分布 (2013)	单位:%	30
表 6 日均订单执行价格分布 (2013)		31

一、引言

市场质量是衡量证券市场核心竞争力的重要指标，对市场质量指标的关注程度则是市场成熟与否的重要标志。市场质量是市场组织者和监管者推动市场创新与发展的指南，也是投资者进行交易决策的重要依据。

随着量化交易的兴起，市场质量问题越来越受到市场各方关注。自2006年起，上海证券交易所持续发布每一年度的证券市场质量报告。我们希望，市场质量报告能实现以下几方面目标：

1、为监管机构和市场监察提供参考。比如监管者可以根据市场质量指标，为专业性机构投资者制定投资指引；市场一线监管部门可以根据市场质量指标来针对性的对某些板块或者某些证券交易加强监察力度。

2、为市场组织者（证券交易所）改进市场质量提供指南。市场质量也是反映证券交易所核心竞争力的综合标志，通过分析市场质量的一些关键指标（如流动性和波动性），交易所得以检讨自身的市场结构和交易机制设计，从而不断改进市场质量，提升市场竞争力。

3、为投资者特别是机构投资者提供投资决策参考。市场质量指标可以使投资者更精确地估计交易成本，为其判断套利、风险对冲和程序交易等投资决策时的风险和收益提供有力的支撑。

4、为筹资者的筹资决策提供支持。高流动性的市场可以更好地发挥其筹资和优化资源配置的功能，使企业能以较低的成本在发行市场筹集资金。此外，筹资者还可以通过分析和比较市场质量指标，选择最有利的时机在最有利的市场以最有利的方式进行筹资。

5、为其他市场参与者和市场创新提供支持。比如，可参考市场质量指标编制指数，创造基础证券组合，并在此基础上开发金融衍生产品。

二、证券交易市场质量

（一）流动性与交易成本

1、价格冲击指数

2013 年市场处于震荡状态，投资者交易意愿有所提升，这促使价格冲击指数有所下降，沪市流动性相比 2012 年有所提高。

本报告分别计算了买卖 10 万元、25 万元、90 万元股票的流动性成本（价格冲击指数，即买卖一定金额股票所产生的反向价格变化的平均成本）。从交易 10 万元股票的价格冲击指数的指标来看（见图 1），相对 1995 年股市建设初期的 199 个基点（1 个基点等于万分之一），2013 年下降到 16 个基点，流动性成本从整体来看呈现显著下跌趋势，市场流动性出现较大改善。相比较 2012 年的 19 个基点，10 万元股票价格冲击指数下降了 16%。如果分别从买卖两个方向分析，买卖双方价格冲击成本基本趋于相同（见图 2）。

从 2013 年各月数据看（见图 3），流动性成本与市场整体走势、资金有关。全年流动性成本相对较为稳定，只有 6、7 月份由于大盘的下跌，交易成本快速增长，达到全年最高点，8 月份随着大盘回升，流动性成本开始回落，全年剩余月份均没有超过 7 月份的高点。这说明在市场处于谷底阶段时流动性成本较高，而市场处于较高点位时流动性成本较低。

从按板块分组的结果来看（见图 4），上证 50 成份股流动性成本最低，上证 180 成份股（不含上证 50 成份股，下同）次之，B 股和 ST 股票（含*ST 股票，下同）最高。以 10 万元交易金额为例，ST 股价格冲击指数为上证 50 成份股的 3.75 倍，B 股票价格冲击指数为上证 50 成份股的 5.4 倍。

从按股票流通市值分组情况看（见图 5），流通市值越大，流动性成本越低。以 10 万元交易金额为例，流通市值小于 10 亿元的股票价格冲

击指数是流通市值大于 100 亿元股票的 3.6 倍。

从按股价分组情况看（见图 6），总体来看股价越高，股票的流动性成本越低。以 10 万元交易金额为例，单价低于 5 元的股票价格冲击指数是 20 元以上股票的 1.8 倍。

从按行业分组情况看（见图 7），金融、保险业及采掘业股票的流动性成本最低，农、林、牧、渔业和社会服务业股票的流动性成本最高。

图 1 相关年份所有股票价格冲击指数（2013） 单位：基点

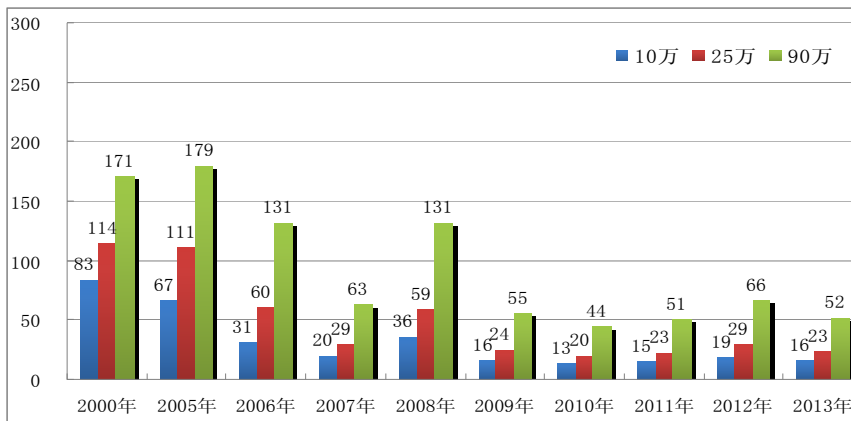


图 2 买方向与卖方向价格冲击指数（2013） 单位：基点

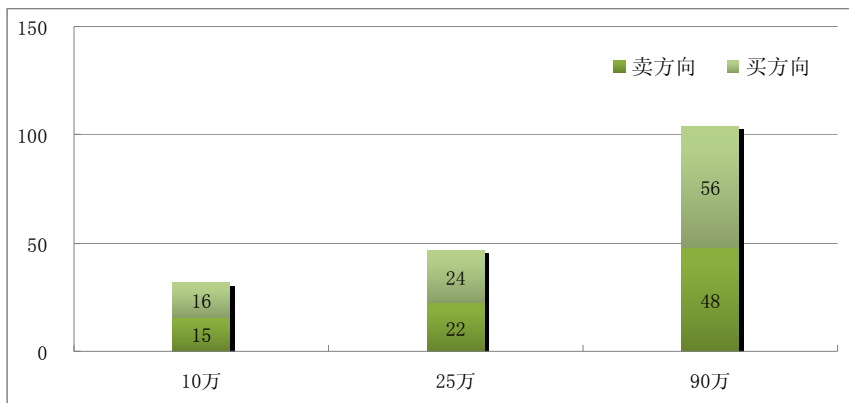


图 3 逐月价格冲击指数（2013）

单位：基点

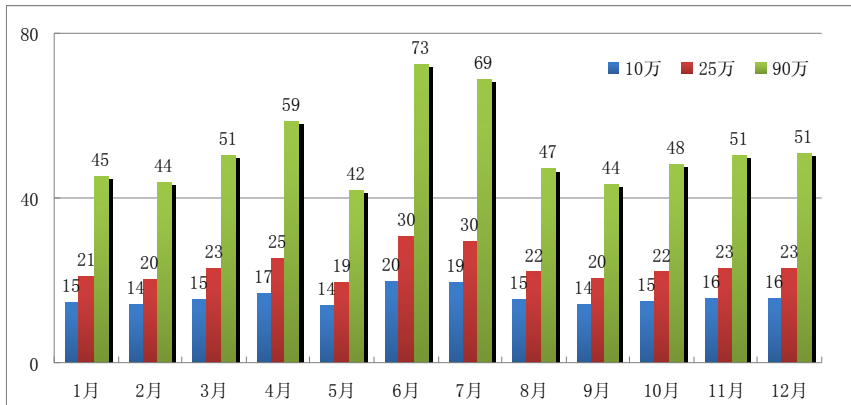


图 4 按板块分组的价格冲击指数（2013）

单位：基点

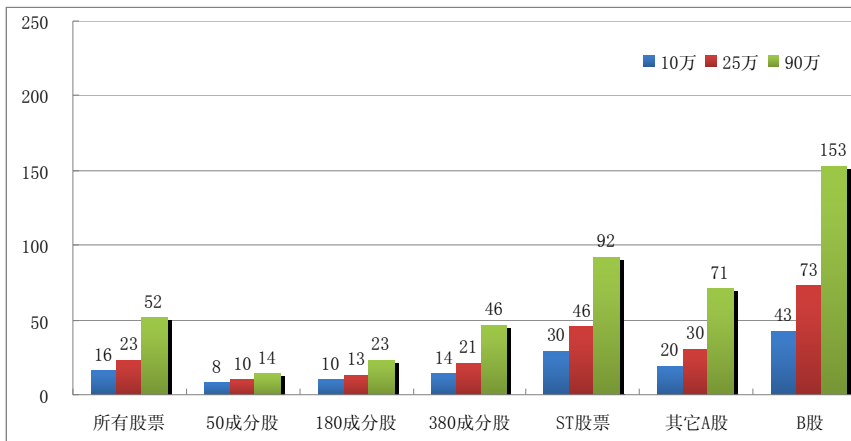


图 5 按流通市值分组的价格冲击指数（2013）

单位：基点

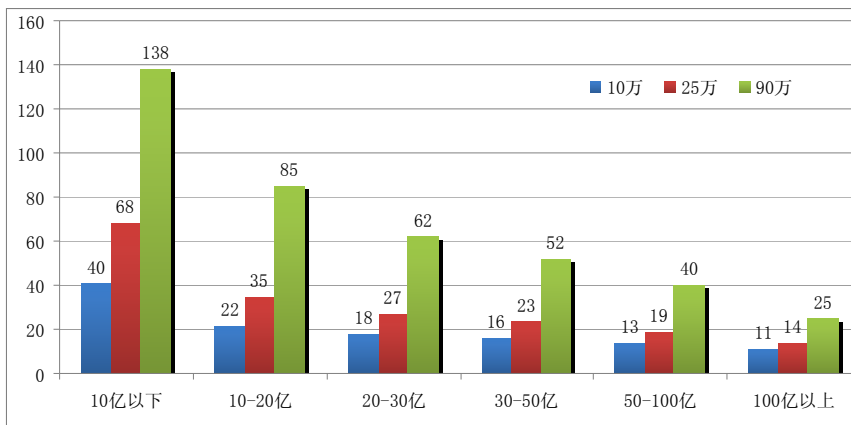


图 6 按股价分组的价格冲击指数（2013） 单位：基点

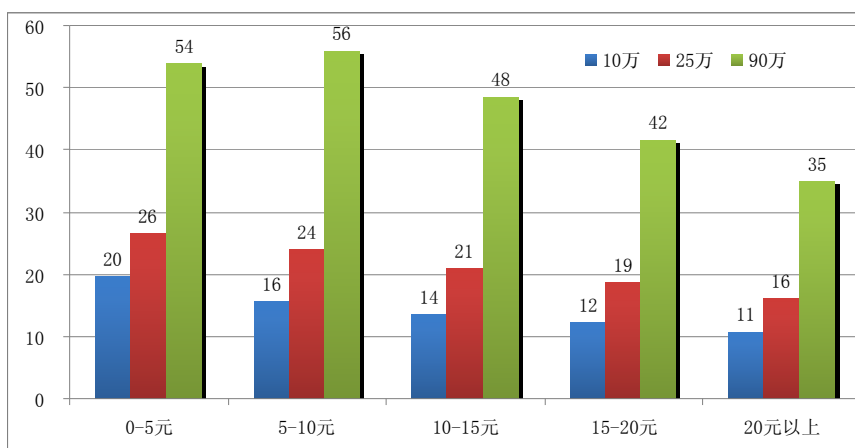
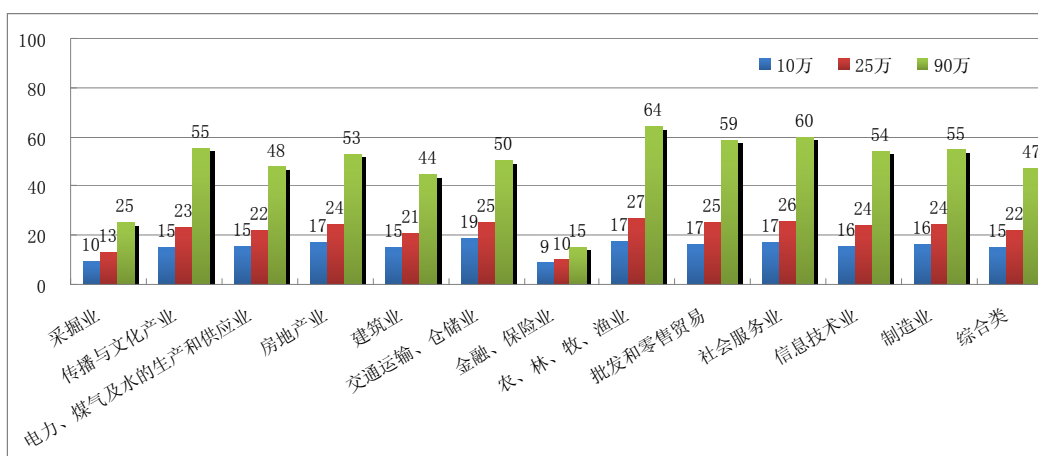


图 7 按行业分类的价格冲击指数（2013） 单位：基点



2、流动性指数

2013 年度流动性指数继续保持良好的水平，并相比 2012 年度有所改善。

本报告定义的流动性指数是指使价格上涨 1%所需要的买入金额和使价格下跌 1%所需要的卖出金额的均值。2013 年沪市流动性指数为 336 万元，比 2012 年的 276 上升了 22%（见图 8）。

从 2013 年各月数据看（见图 9），流动性指数与市场整体走势有关，6、7 月份市场流动性指数较低，全年流动性指数处于相对高位。

从按板块分组的结果看(见图 10), 上证 50 成份股流动性指数最好, B 股最差。使上证 50 成份股价格变化 1%所需要的交易金额平均为 1835 万元,而使 B 股价格变化 1%所需交易金额平均为 53 万元,二者相差 33.8 倍。

从按股票流通市值分组情况看(见图 11), 股票的流通市值越大, 流动性指数越大。例如, 流通市值大于 100 亿元的股票流动性指数为 883 万元, 是流通市值在 10 亿元以下股票的约 15.5 倍。

从按股价分组情况看(见图 12), 价格处于 20 元以上股票的流动性指数最大。单价在 20 元以上股票的流动性指数为 463 万元, 而 5-10 元股票的流动性指数为 276 万元, 二者相差约 67%。

从按行业分组情况看(见图 13), 金融、保险业类股票的流动性指数最高, 为 2128 万元, 而批发和零售贸易类股票的流动性指数最低, 为 195 万元。

图 8 相关年份流动性指数 (2013)

单位: 万元

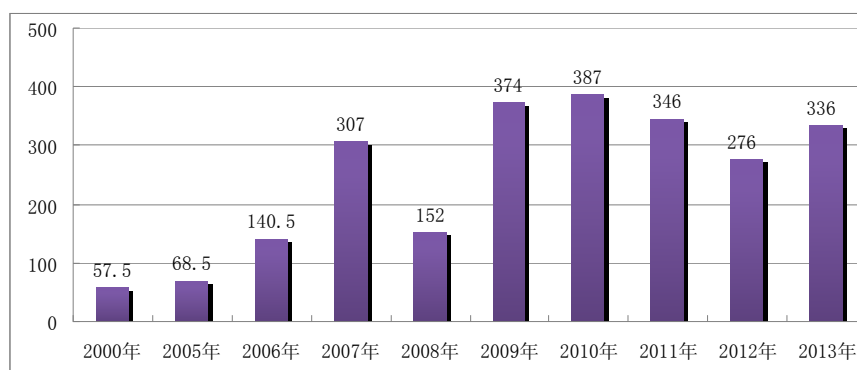


图 9 逐月流动性指数（2013）

单位：万元

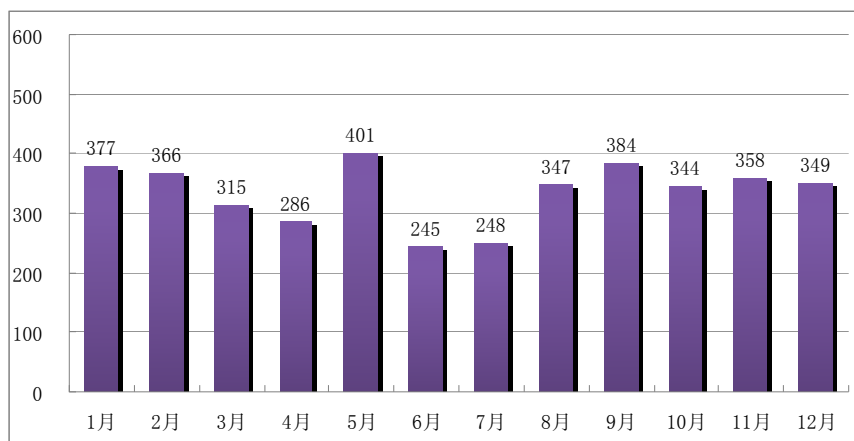


图 10 按板块分组的流动性指数（2013）

单位：万元

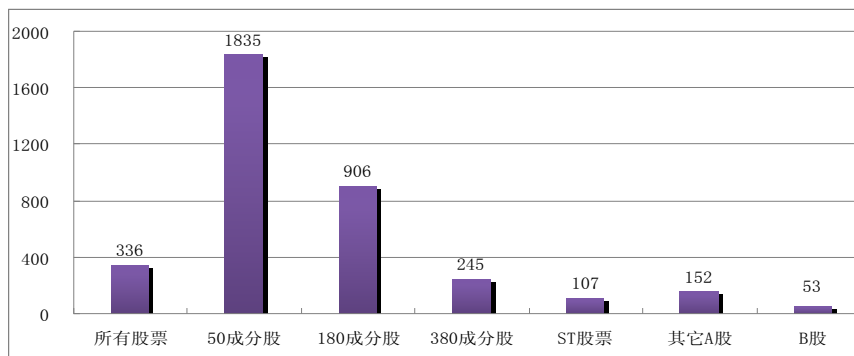


图 11 按流通市值分组的流动性指数（2013）

单位：万元

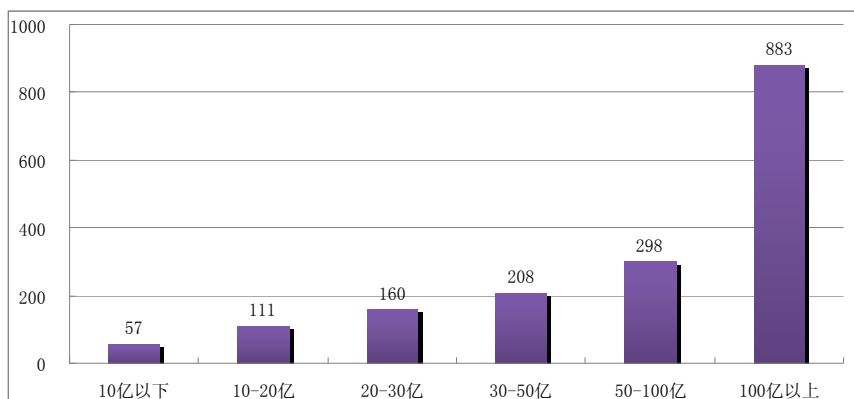


图 12 按股价分组的流动性指数（2013） 单位：万元

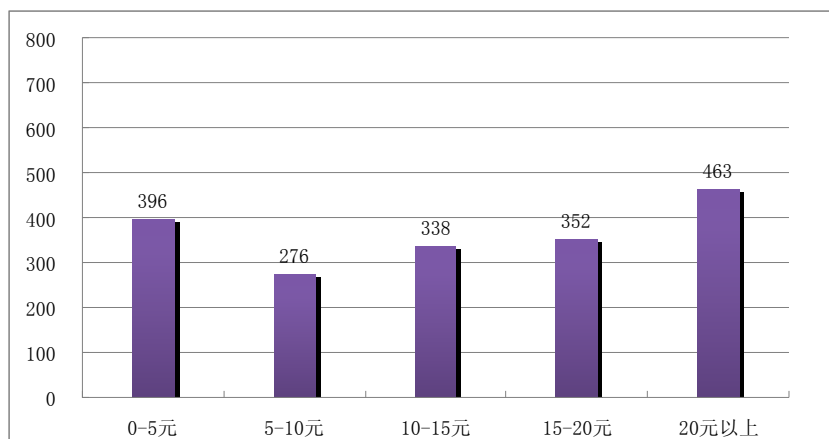
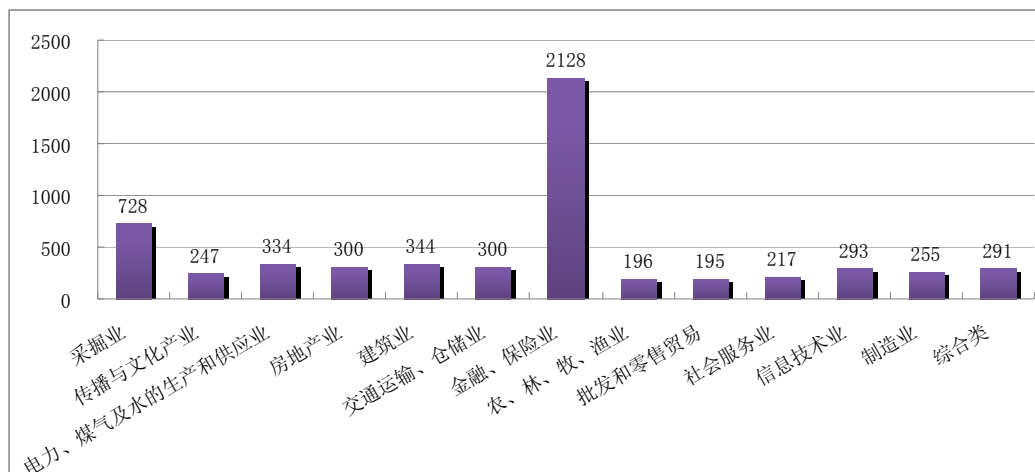


图 13 按行业分类的流动性指数（2013） 单位：万元



3、买卖价差

2013 年度买卖价差保持良好水平，侧面表明沪市流动性水平较高，信息不对称程度保持在低位。

2013 年沪市绝对买卖价差与 2012 年略有下降，为 1.5 分，相对买卖价差也下降了 1 个基点。从 2013 年各月数据看（见图 16），绝对买卖价差全年相对均衡，波动范围在 1.4-1.6 之间。相对买卖价差全年相对均衡（见图 17），在 18-22 之间波动。

从按板块分组的结果看（见图 18），上证 50 成份股的相对买卖价差最小，为 14 个基点，B 股最大，为 33 个基点，是上证 50 成份股的 2.4

倍。

从按股票流通市值分组情况看（见图 19），股票的流通市值越大，相对买卖价差越小。流通市值大于 100 亿元股票的相对买卖价差为 16 个基点，仅为流通市值小于 10 亿元股票的 48%。

从按股价分组情况看（见图 20），股价在 20 元以上股票的相对买卖价差最小，为 11 个基点左右，而股价在 5 元以下股票的相对买卖价差明显较高，为 28 个基点。

从按行业分组情况看（见图 21），交通运输与仓储的相对买卖价差最大，为 27 个基点，采掘业和金融、保险业最小，为 14 个基点。

图 14 相关年份绝对买卖价差（2013）

单位：分

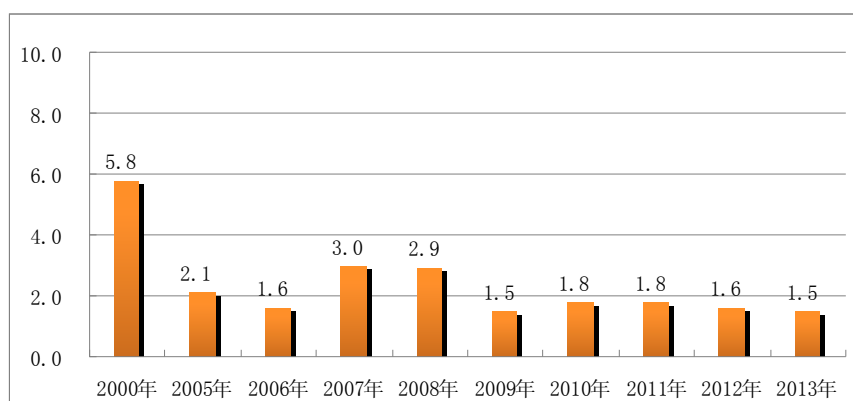


图 15 相关年份相对买卖价差（2013）

单位：基点

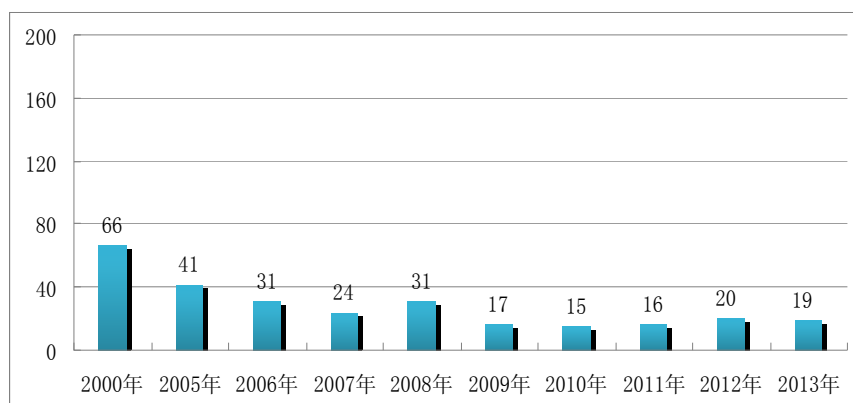


图 16 逐月绝对买卖价差 (2013)

单位: 分

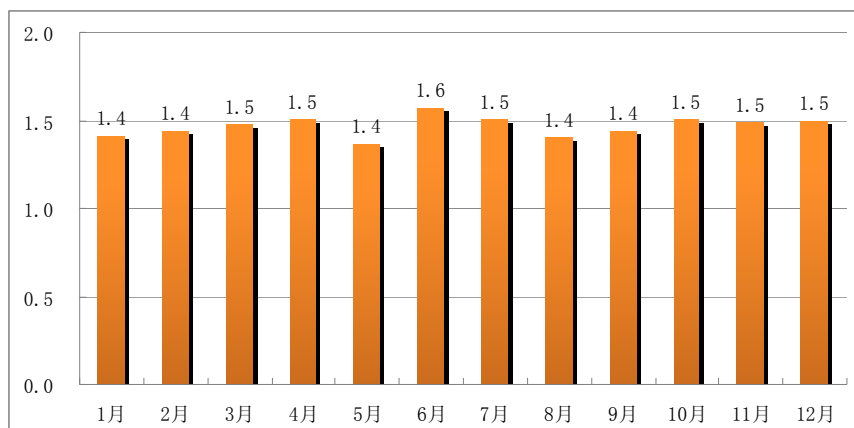


图 17 逐月相对买卖价差 (2013)

单位: 基点

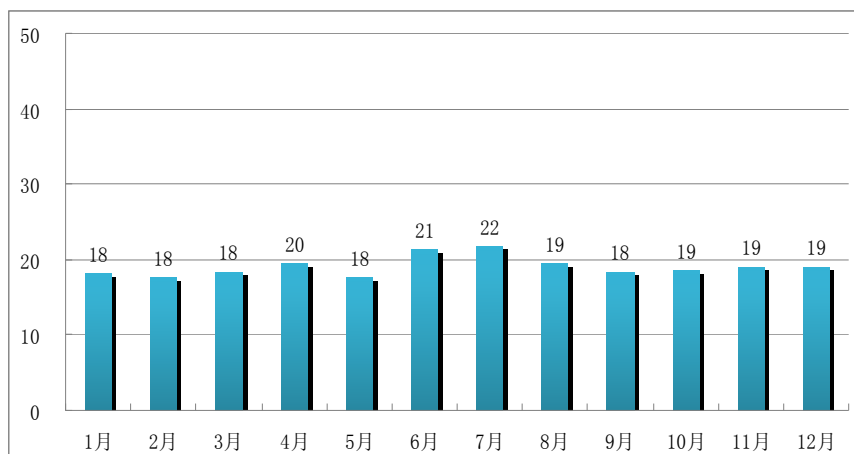


图 18 按板块分组的相对买卖价差 (2013)

单位: 基点

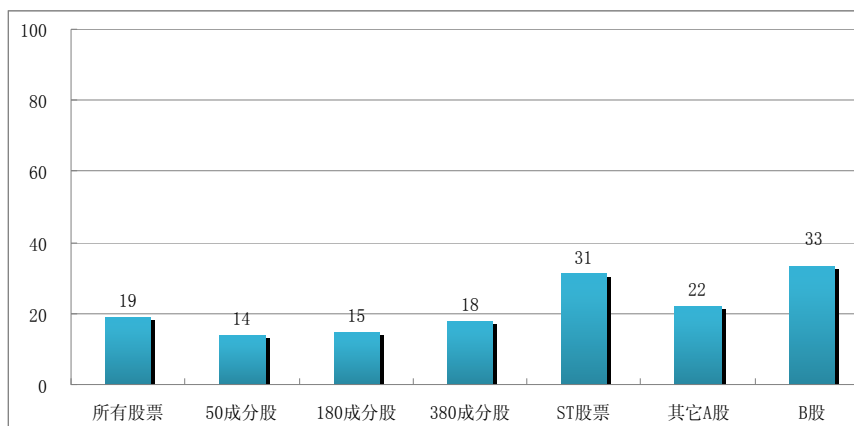


图 19 按流通市值分组的相对买卖价差（2013）单位：基点

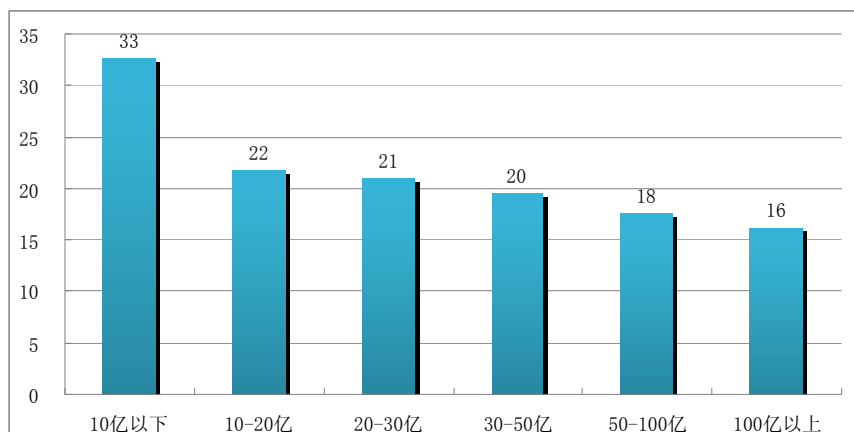


图 20 按股价分组的相对买卖价差（2013）单位：基点

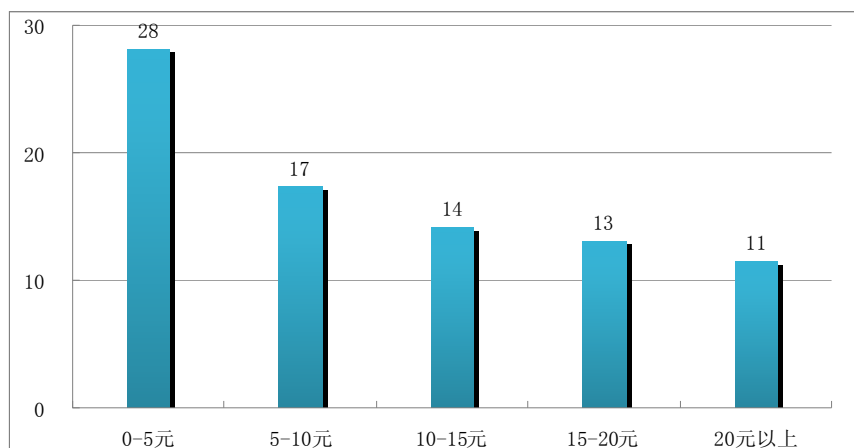
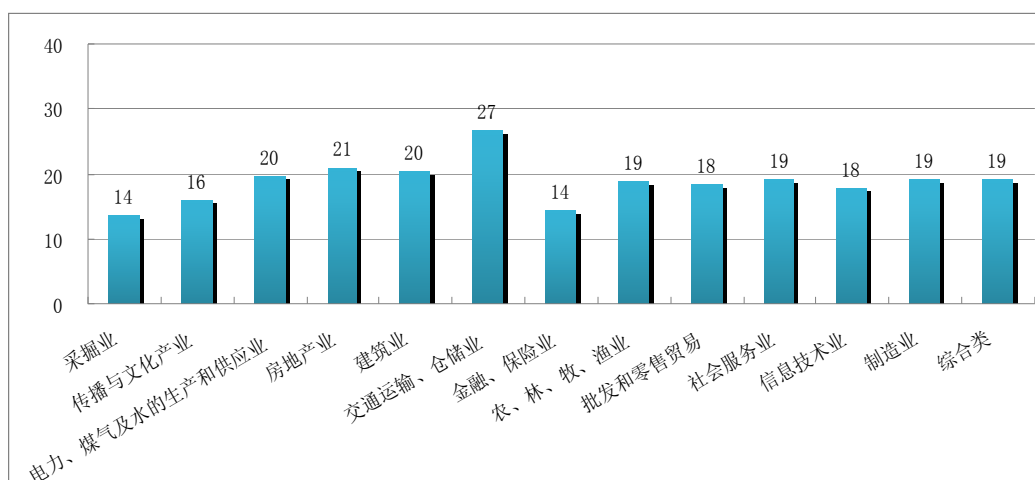


图 21 按行业分类的相对买卖价差（2013）单位：基点



4、有效价差

2013年度有效价差保持着良好水平。

2013年沪市股票的绝对有效价差为3.0分，与2012年相同，相对有效价差也与2012年相同。从2013年各月数据看（见图24和图25），绝对有效价差和相对有效价差较为稳定。

从按板块分组的结果看（见图26），上证50成份股的相对有效价差最小，为28个基点，而B股最大，为44个基点，是上证50成份股的1.6倍。

从按股票流通市值分组情况看（见图27），10亿流动市值以下的股票的相对有效价差最大，为44个基点，100亿流动市值以上的股票的相对有效价差最小，为30个基点。

从按股价分组情况看（见图28），价格越高，股票的相对有效价差越小。价格在5元以下股票的相对有效价差为44个基点，而价格在20元以上的股票的相对有效价差为26个基点。

从按行业分组情况看（见图29），采掘业的股票相对有效价差最小，分别为26个基点。交通运输业股票相对有效价差最大为41个基点。

图 22 相关年份绝对有效价差（2013）

单位：分

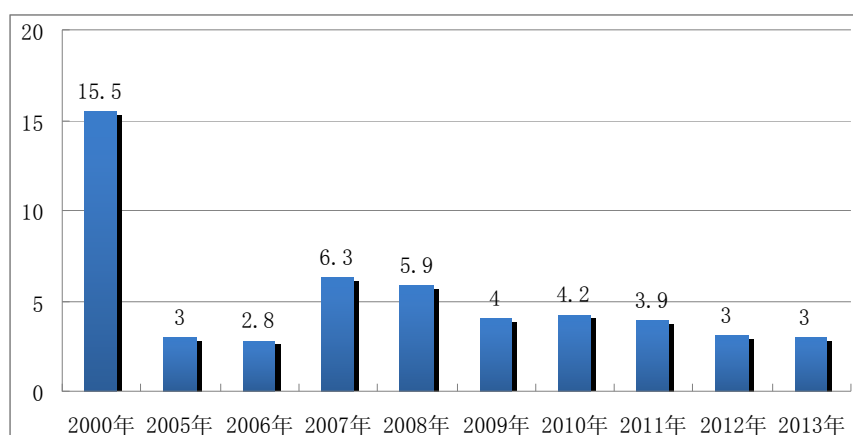


图 23 相关年份相对有效价差（2013）

单位：基点

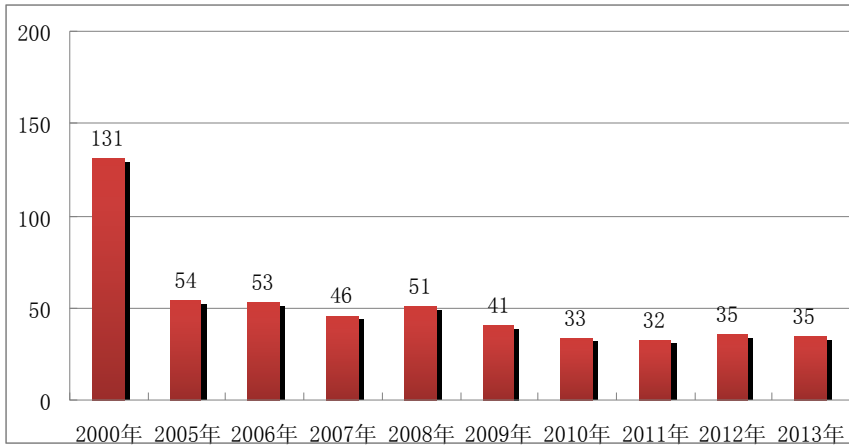


图 24 逐月绝对有效价差（2013）

单位：分

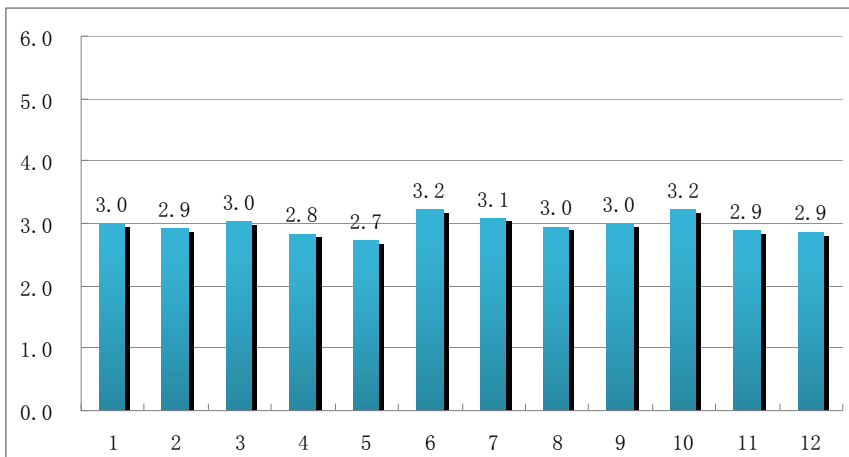


图 25 逐月相对有效价差（2013）

单位：基点

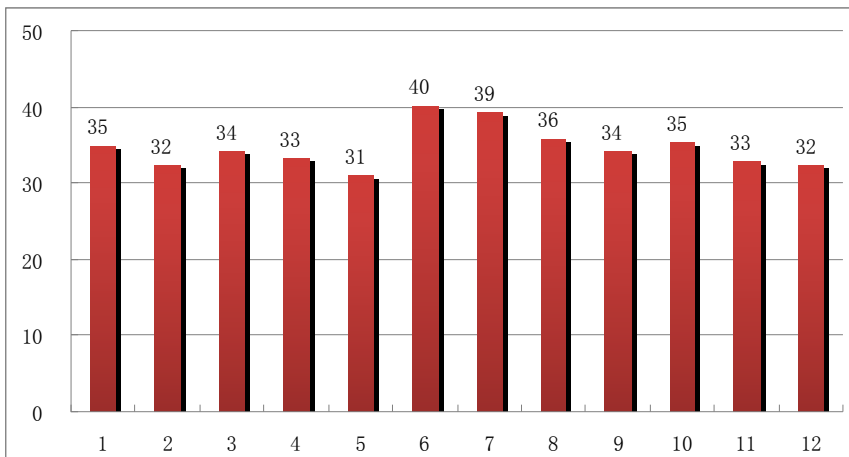


图 26 按板块分组的相对有效价差（2013） 单位：基点

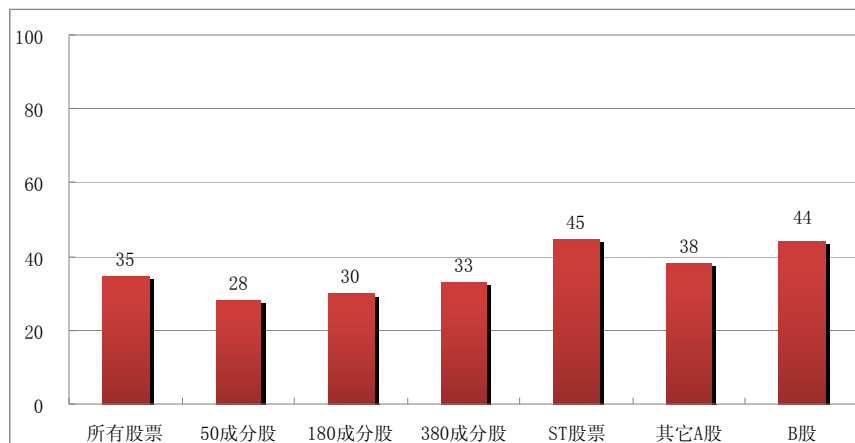


图 27 按流通市值分组的相对有效价差（2013） 单位：基点

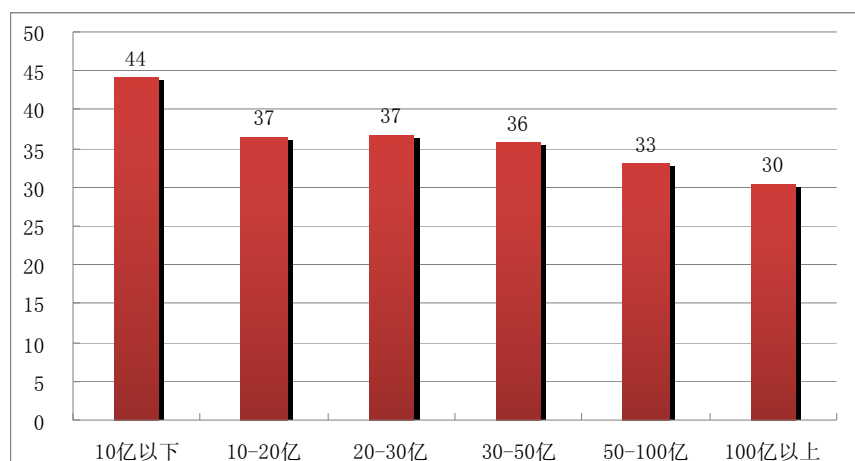


图 28 按股价分组的相对有效价差（2013） 单位：基点

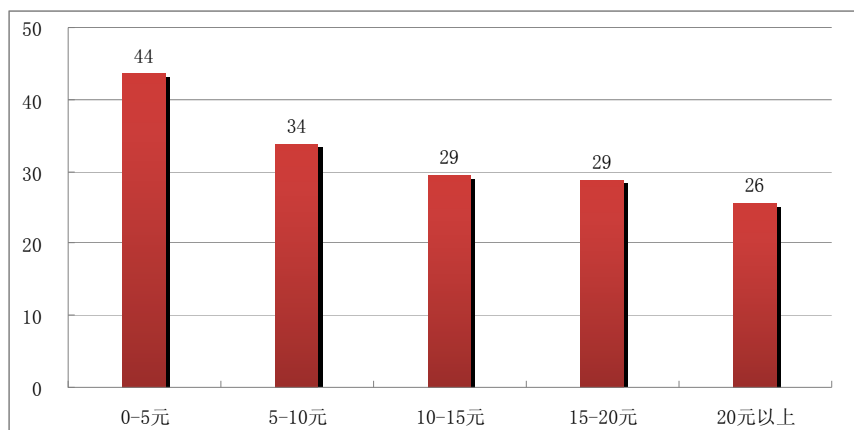
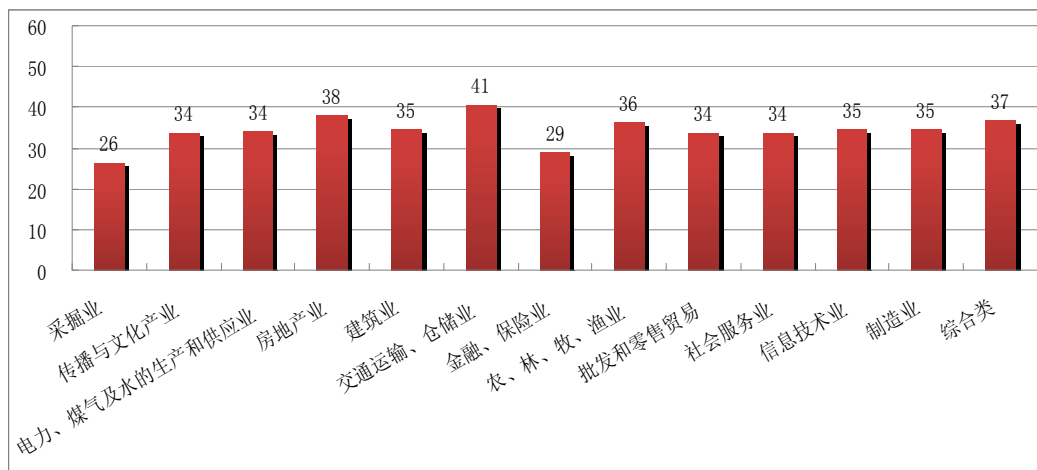


图 29 按行业分类的相对有效价差（2013） 单位：基点



5、订单（市场）深度

2013 年沪市成交活跃，订单深度指标达 2006 年以来的最大值，市场流动性较为充沛。

订单深度是衡量市场深度的最直接的指标，我们选择了最佳五个买卖报价上所有买卖订单合计金额和最佳十个买卖报价上所有买卖订单合计金额作为订单深度的代理指标。

2013 年沪市成交量仍然活跃，订单深度继续保持较大值（见图 30）。5 档订单深度为 470 万元，10 档订单深度为 850 万元，两档订单深度较 2012 年提高了约 25%。

从 2013 年各月数据看（见图 31），订单深度只在 6、7 月份出现下降，而后迅速回升。其中，5 档订单深度最大值出现在 5 月份，10 档订单深度最大值出现在 1 月份，分别为 550、976 万元，6 月份最低，5 档订单深度和 10 档订单深度分别为 351、620 万元。

从按板块分组的结果看（见图 32），上证 50 成份股的订单深度明显优于其他板块，上证 180 成份股次之，而 B 股最差。以 5 档订单深度为例，上证 50 成份股的订单深度为 2367 万元，是 B 股的 32.4 倍。

从按股票流通市值分组情况看（见图 33），流通市值越大，订单深度越大。流通市值大于 100 亿元股票的 5 档订单深度为 1213 万元，是流通市值小于 10 亿元股票的 14.3 倍。

从按股价分组情况看（见图 34），价格在 5 元以下的股票的订单深度最大，价格在 10-20 元股票订单深度较低。

从按行业分组情况看（见图 35），金融、保险业的股票订单深度保持最大，传播与文化产业的股票订单深度最低。

图 30 相关年份市场订单深度（2013） 单位：万元

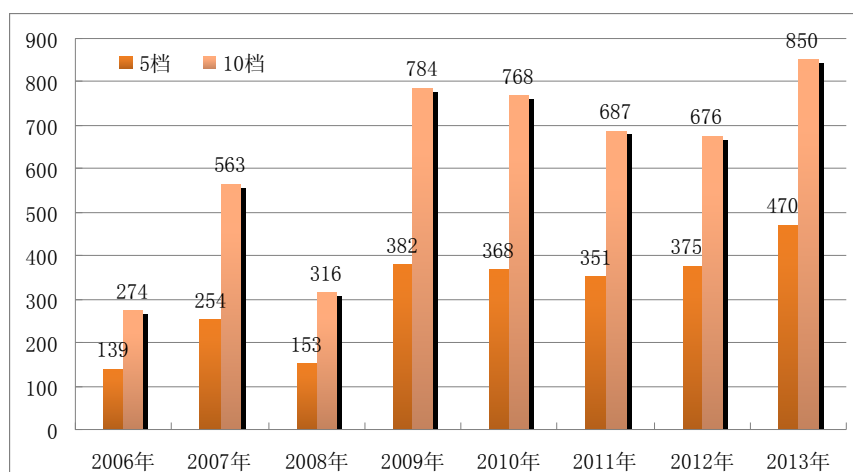


图 31 逐月订单深度 (2013)

单位: 万元

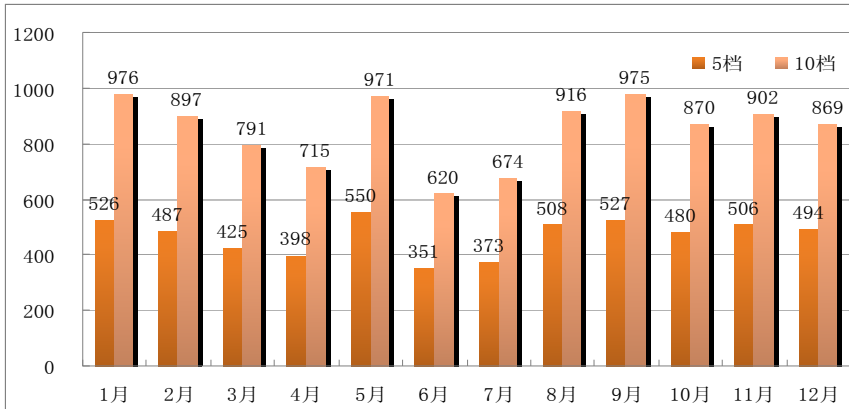


图 32 按板块分组的订单深度 (2013)

单位: 万元

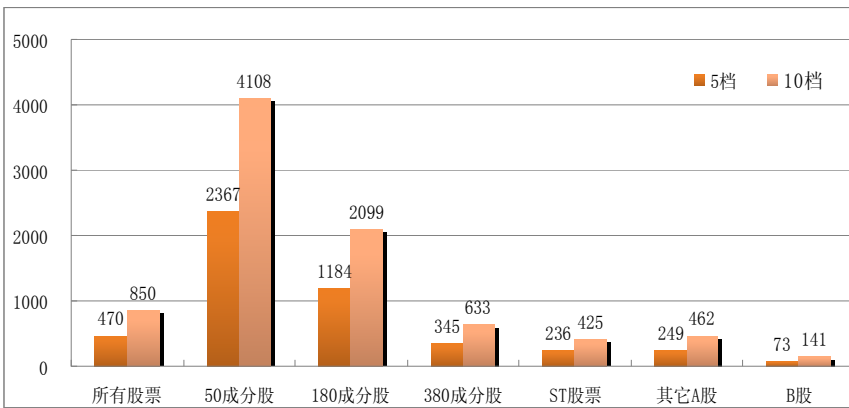


图 33 按流通市值分组的订单深度 (2013)

单位: 万元

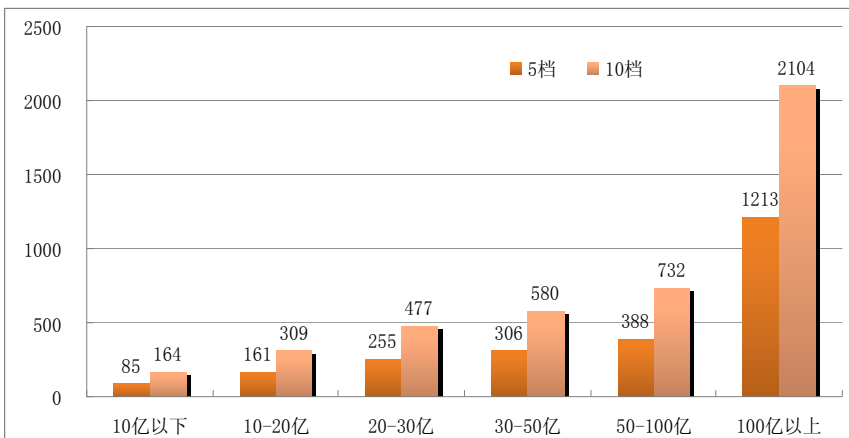


图 34 按股价分组的订单深度（2013）

单位：万元

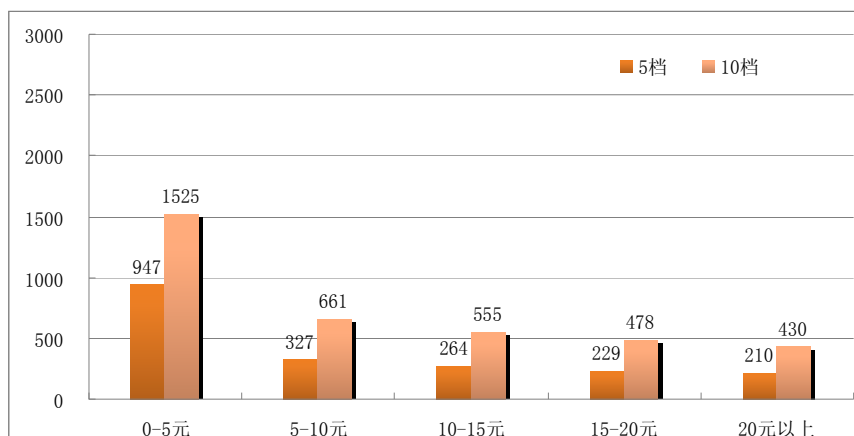
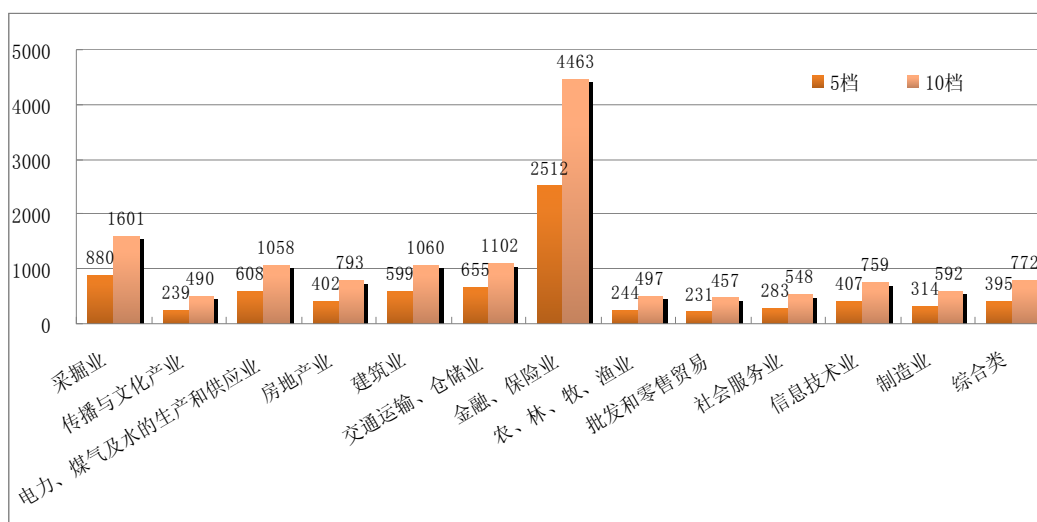


图 35 按行业分类的订单深度（2013）

单位：万元



6、大宗交易成本

2013 年度沪市大宗交易成本继续保持在相对较低的水平，并相比上一年度有所下降。

本报告以买卖 300 万元股票的价格冲击指数衡量大宗交易成本。2013 年沪市大宗交易的流动性成本比 2012 年在买卖两个方向上均有所下降，分别下降了 28、13 个基点。从买卖方向看，大宗交易的买方向流动性成本要大于卖方向流动性成本，买方向流动性成本是卖方向的 1.4 倍。

从 2013 年各月数据看（见图 37），大宗交易的流动性成本仅在 6、7 月份出现短暂上升，分别为 145、136 个基点，5 月份最低，为 91 个基点，二者相差约 50%。

从按板块分组的结果看（见图 38），上证 50 成份股的大宗交易的流动性成本最低，为 27 个基点，上证 180 成份股次之，为 52 个基点，而 ST 股票和 B 股的流动性成本最高，分别为 156、223 个基点，是上证 50 成份股的 5.8 倍、8.3 倍。

从按股票流通市值分组情况看（见图 39），流通市值越大，大宗交易的流动性成本越低。流通市值在 10 亿元以下股票的大宗交易的流动性成本为 191 个基点，约为 100 亿元以上股票的 3.5 倍。

从按股价分组情况看（见图 40），5-10 元股票的大宗交易的流动性成本约为 120 个基点，约为 20 元以上股票的 1.4 倍。

从按行业分组情况看（见图 41），金融、保险业大宗交易的流动性成本最低，为 30 个基点，农、林、牧、渔业最高，为 140 个基点。

图 36 相关年份大宗交易成本（2013） **单位：基点**

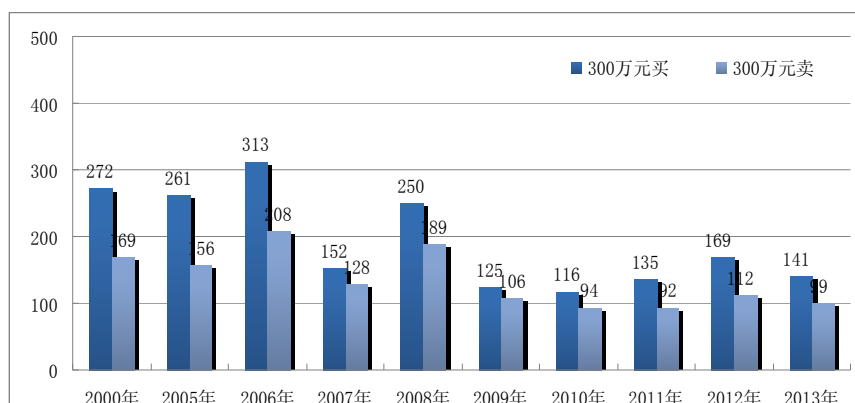


图 37 逐月大宗交易成本（2013）

单位：基点

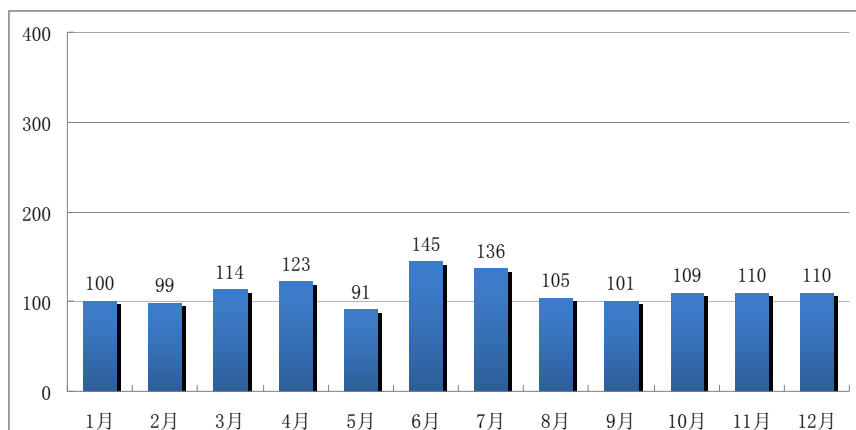


图 38 按板块分组的大宗交易成本（2013）

单位：基点

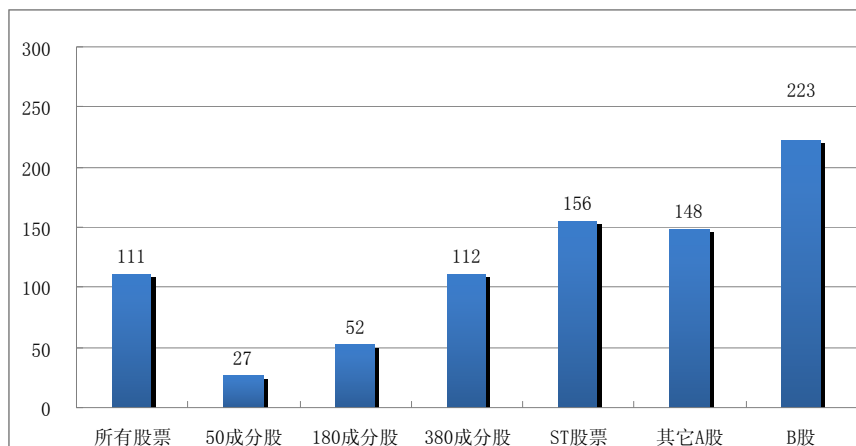


图 39 按流通市值分组的大宗交易成本（2013）

单位：基点

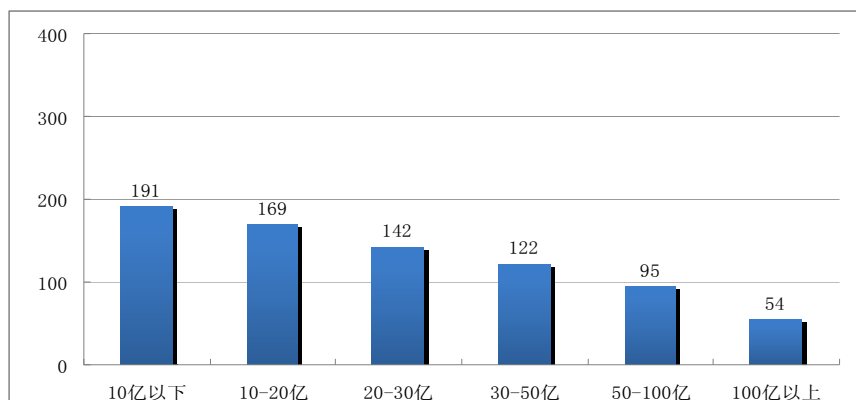


图 40 按股价分组的大宗交易成本（2013） 单位：基点

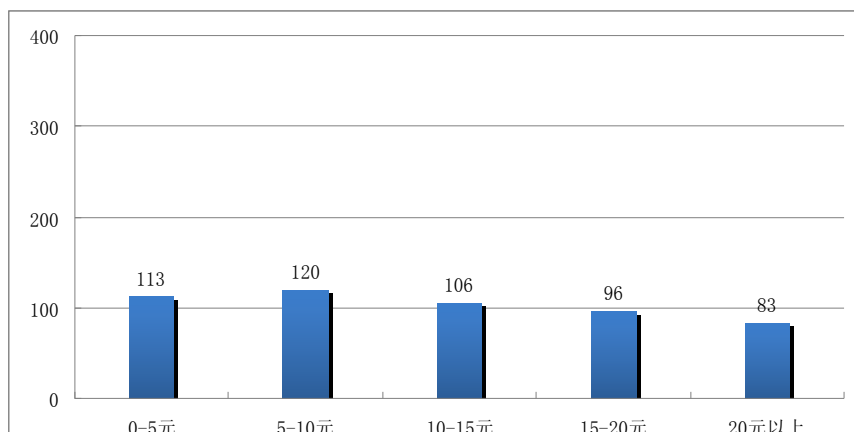
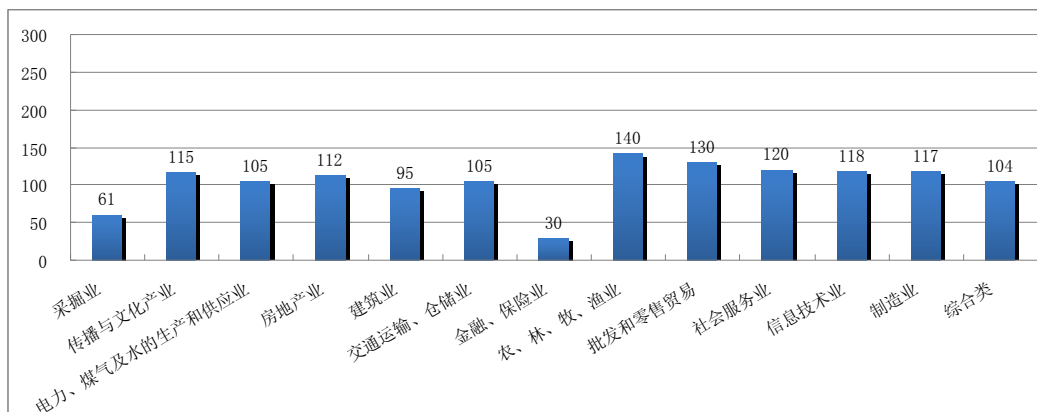


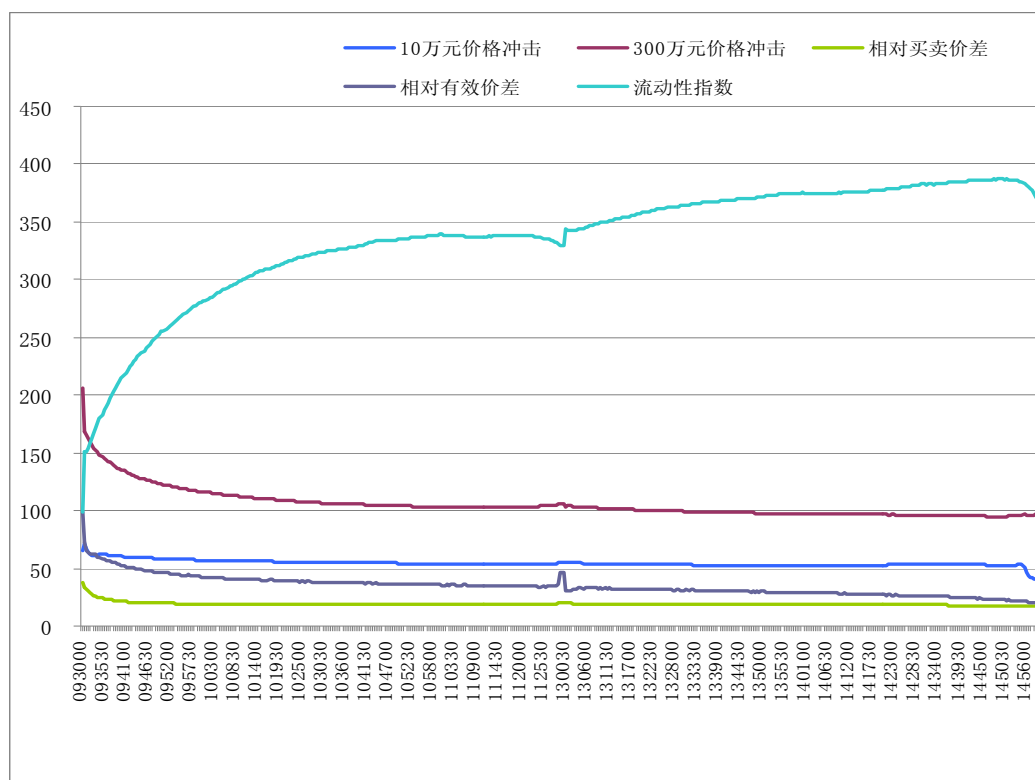
图 41 按行业分类的大宗交易成本（2013） 单位：基点



7、流动性指标的日内特征

2013年沪市交易市场日内主要流动性特征与历年基本相同，在上午开盘时市场流动性最差（大宗交易成本、价格冲击指数和相对有效价差数值较高，流动性指数较低），在开盘后一小时内市场流动性有较大增长，随后市场流动性逐步增加，在下午收盘前市场流动性进一步得到改善。

图 42 流动性指标的日内特征（2013）



注：流动性指数计量单位为万元，其他指标计量单位为基点。

（二）波动性

与历史平均水平相比，2013 年度沪市波动性整体上较为平稳，不过日内波动率略有提高。

本报告计算了沪市股票日内 5 分钟的日内波动率、超额波动率及收益波动率。2013 年沪市的超额波动率和收益波动率与 2012 年基本持平，日内波动率比 2012 年上升了 5 个基点（见图 43）。

从按板块分组的统计结果看（见图 44），上证 50 成份股的收益波动率最低，其他板块基本相同。ST 股票日内波动率和超额波动率较小，其他板块基本相同。

从按股票流通市值分组情况看（见图 45），日内波动率、超额波动率和收益波动率与流通市值基本呈正相关关系，但变化幅度相对较小。

从按股价分组情况看（见图 46），基本上是股价越高、收益波动率越大。而日内波动率和超额波动率随股价变化不大。

从按行业分类情况看（见图 47），综合类股票的日内波动率、超额波动率和收益波动率相对较高，采掘类股票的日内波动率和收益波动率较低。

从波动率的日内特征看（见图 48），相对波动率、超额波动率及收益波动率都表现出明显的“L”形，即在市场刚开盘和收盘时波动较大，10:00 过后市场波动明显变小，在中午休市前后出现短暂波动，随后回落到正常水平。

图 43 相关年份波动率（2013）

单位：基点

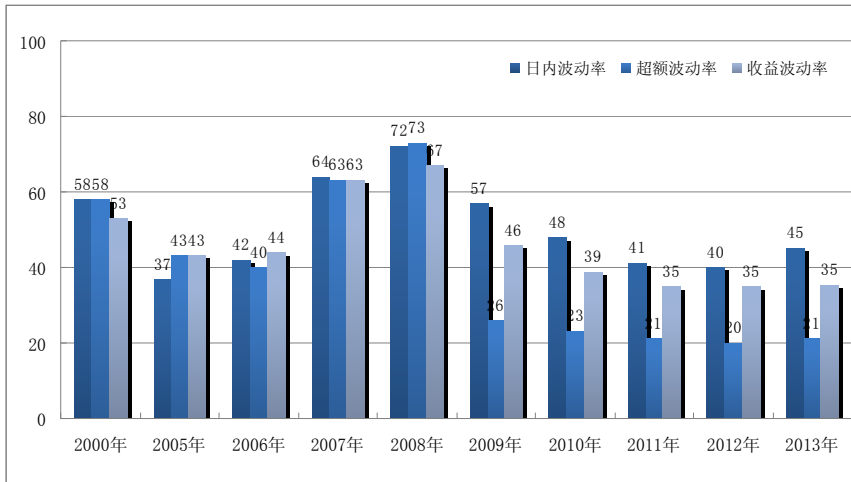


图 44 按板块分组的波动率（2013）

单位：基点

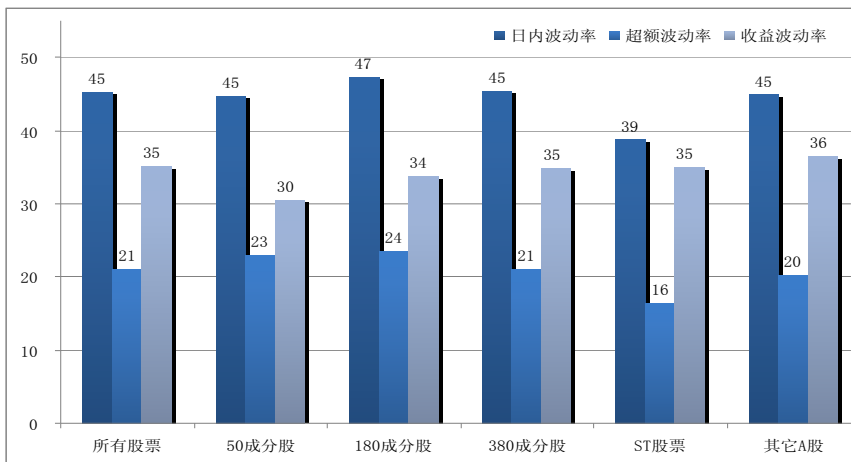


图 45 按流通市值分组的波动率（2013）

单位：基点

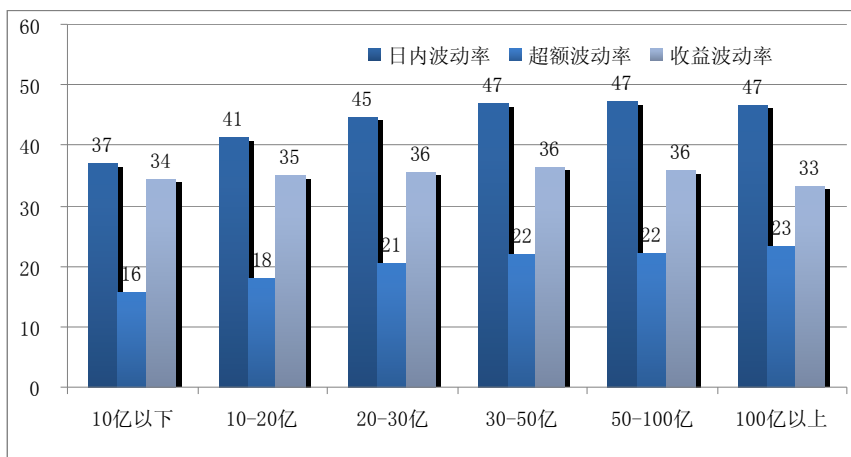


图 46 按股价分组的波动率（2013）

单位：基点

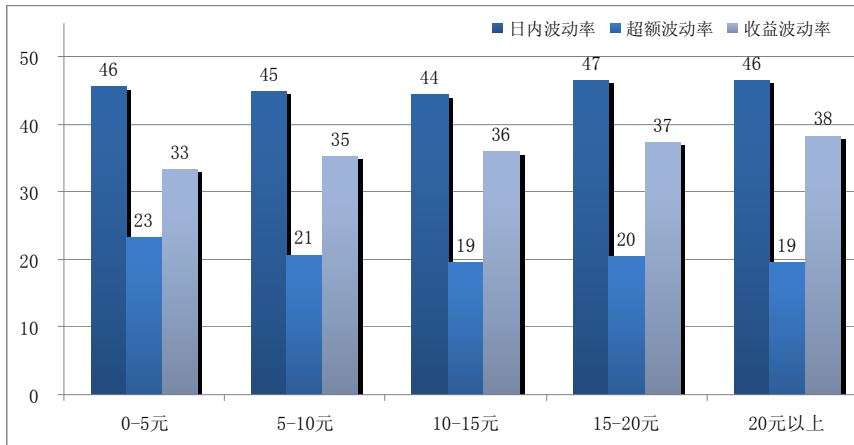


图 47 按行业分组的波动率（2013）

单位：基点

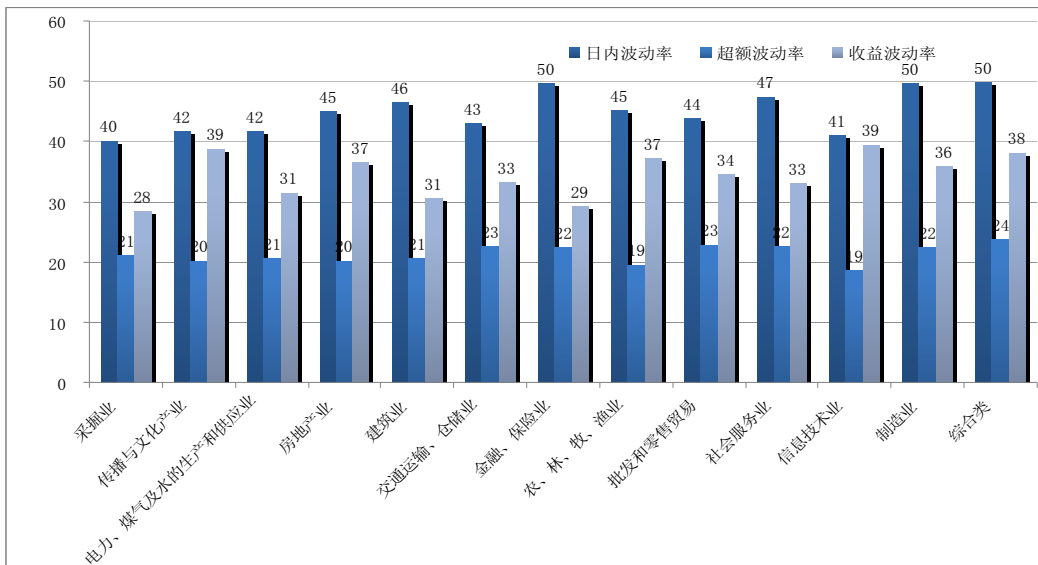
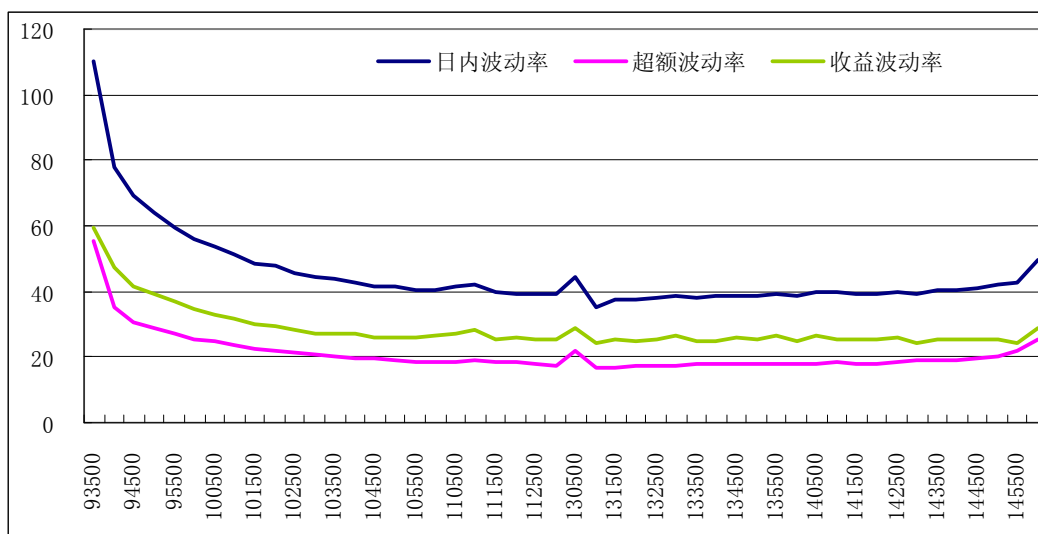


图 48 日内波动走势图（2013）

单位：基点



（三）市场质量指数

沪市市场质量继续保持在良好水平，与上一年度基本持平。

市场质量指数是衡量证券交易市场流动性和波动性的综合指标，以2000年为基期（等于100）。近十年来，沪市市场质量指数增长迅速，2013年市场质量指数为327（见图49）。

从板块分组来看，各板块的市场质量指数非常近似，只有B股板块的市场质量指数相对较低（见图50）。

从流动市值分组来看，市值在10亿元以下的市场质量指数相对较低，只有286，而100亿元以上股票的相对最高，为353，市场质量指数基本随着市值增加有所提高（见图51）。

从股价分组来看，股价越低的股票，市场质量指数就越低，股价越高的股票，市场质量指数则相对较高，20元以上股票是5元以下股票质量指数的1.47倍（见图52）。

从行业分组来看，采掘业和金融、保险业的市場质量指数相对较高，分别为387和356，交通运输的市场质量指数较低为289（见图53）。

图49 相关年份的市场质量指数（2013）

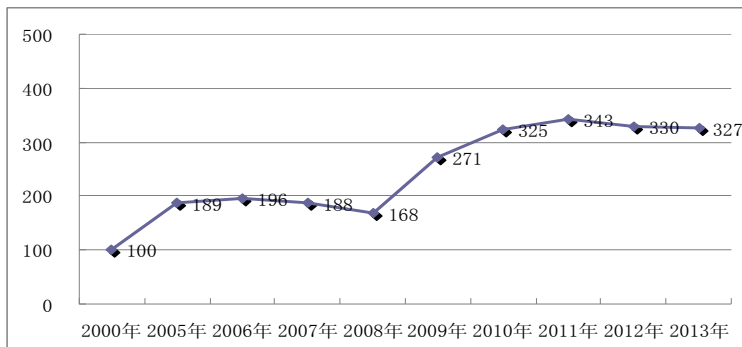


图50 按板块分组的市场质量指数（2013）

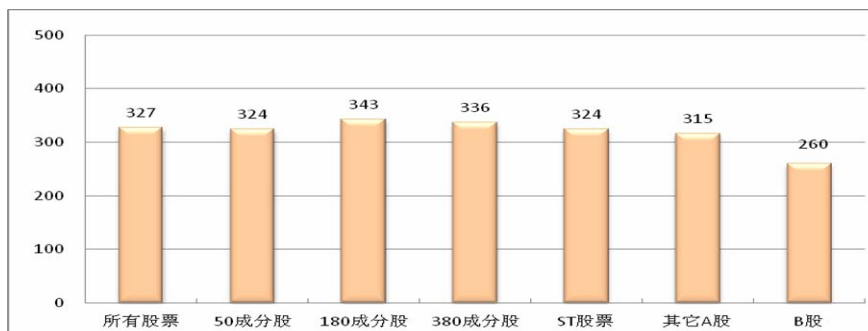


图 51 按流通市值分组的市场质量指数（2013）

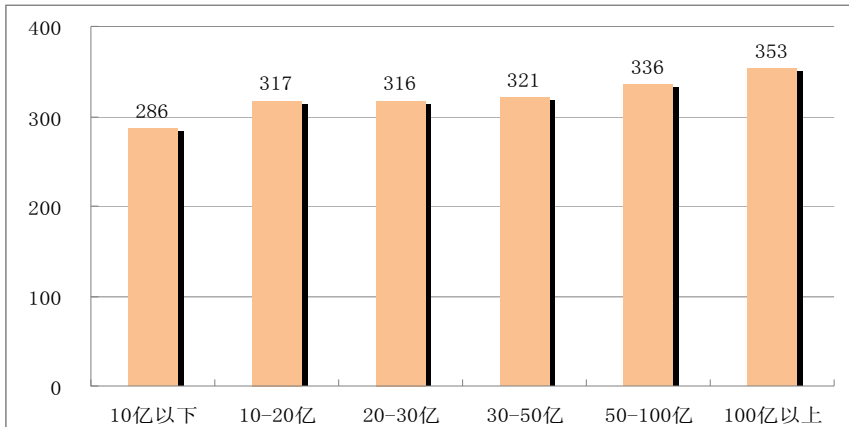


图 52 按股价分组的市场质量指数（2013）

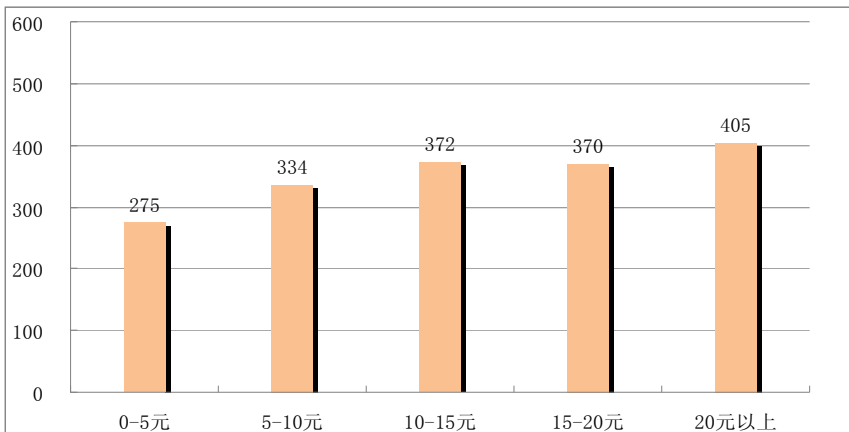
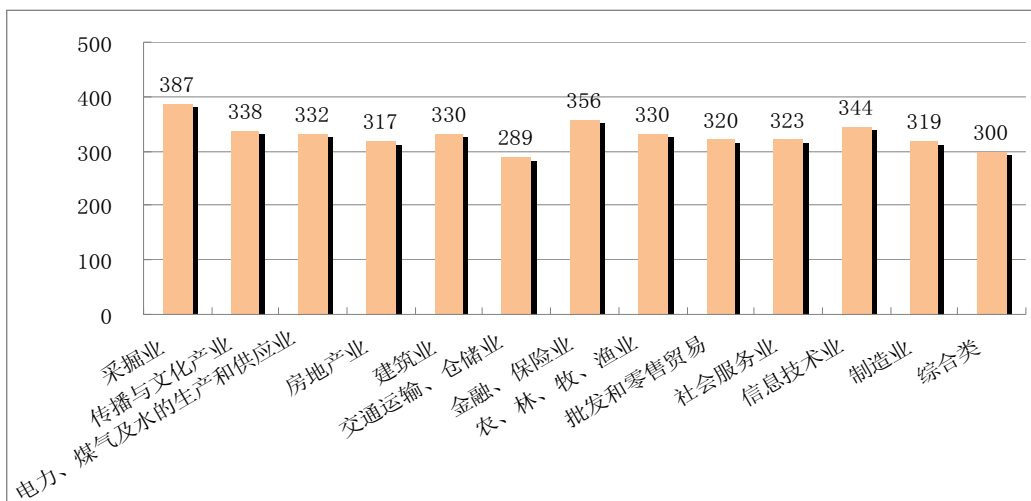


图 53 按行业分类的市场质量指数（2013）



三、订单执行质量

2013 年订单执行较为高效，执行质量继续保持在良好水平。

2013 年订单每笔平均申报和成交金额较 2012 年略有下降，其余指数与 2012 年基本持平。

从订单申报金额或订单大小来看：2013 年，沪市平均每笔申报金额为 3.3 万元，为 2012 年的 96.2%，每笔成交金额 1.6 万元，为 2012 年（1.77 万元/笔）的 90.4%。申报金额分布中，有 51.38% 的订单申报金额不超过 1 万元（2012 年占比为 53.17%），另有 41.32% 的订单在 1 万与 10 万元之间，6.27% 的订单在十万与五十万元之间，1.03% 的订单超过 50 万元。订单申报分布趋向于两端增加，平均金额有所下降。

从订单申报、成交及撤单笔数来看，2013 年，沪市平均每天的有效报单笔数为 786.07 万笔，成交 481.93 万笔（单向）。虽然平均每天的有效报单笔数小于 2012 年的 832.7 万笔，但成交笔数较 2012 年的 400.9 万笔，提高了 20%，订单成交率出现显著提高。撤单笔数平均每交易日有 190.19 万笔，约占有效报单笔数的 24.29%¹，撤单笔数占比继续维持在 25% 附近，但较前几年有所下降。

从订单申报时间段来看，通过将每日交易时间分成 17 个时段（集合竞价时段及连续竞价每 15 分钟为一个时段）来看各时间段的订单申报情况（见表 2）。结果显示，每日开盘和收盘时订单申报最为活跃，其中 9:30 - 9:45 的申报笔数占比达到 12.86%，此时段成交笔数和金额也较多，占比超过十分之一；其次是 09:45 - 10:00，申报笔数占比 9.04%，成交笔数与金额分别占 8.85% 和 8.99%。

从订单类型在各证券品种中应用的分布来看（见表 3），不管从申报

¹ 本处结果直接引用表 4 的结果，计算方法是首先得到每日撤单比例，再进行平均。若用以上提到的“平均每天的有效报单笔数”除以“平均每天撤单数”，结果存在一定误差。

笔数还是股数来看，限价订单使用最为广泛，不同品种的市价订单无论从申报笔数还是股数来看使用都甚少。

从订单成交情况来看（见表4），参与申报的账户中75.41%有成交，如以数量（股数）计算，全年有60.1%的订单得以成交，高于去年水平（2012年为59.7%）。从投资者类型的订单成交情况来看，机构投资者提交的订单股数占14.7%（略低于2012年的15.0%），但成交额占16.55%（高于2012年的10.8%）。

从订单执行时间来看（见表5），以笔数计算，52.9%的订单在提交后一秒内成交（即时成交），累计有61.6%的订单在提交后十秒内成交，相对2012年的62.3%略有下降。

从订单执行价格（成交价格）来看（见表6），以成交量计算，订单的执行价格位于价格涨跌幅（-3%，3%]区间时，2010年占77.7%，2011年占80.2%，2012年占79.7%，2013年占75.8%。

表1 按申报金额日均订单申报情况（2013）

申报笔数分段	平均申报笔数（万笔）	占比(%)
小于等于一万元	499.98	51.38
大于一万小于等于十万元	402.12	41.32
大于十万小于等于五十万元	60.99	6.27
大于五十万小于等于一百万元	6.49	0.67
大于一百万元	3.51	0.36

表2 各时间段申报笔数、成交笔数、成交金额占比情况（2013）单位：%

时间段	申报笔数占比	成交笔数占比	成交金额占比
09:15-09:25	4.66	0.58	0.62
09:30-09:45	12.86	10.94	11.09
09:45-10:00	9.04	8.85	8.99
10:00-10:15	7.39	7.41	7.54
10:15-10:30	6.23	6.40	6.51
10:30-10:45	5.48	5.69	5.74
10:45-11:00	4.91	5.16	5.19
11:00-11:15	4.68	5.02	5.10
11:15-11:30	4.19	4.61	4.66
13:00-13:15	4.97	4.70	4.49
13:15-13:30	4.46	4.80	4.73

13:30-13:45	4.63	5.03	4.96
13:45-14:00	4.67	5.11	5.05
14:00-14:15	4.78	5.28	5.17
14:15-14:30	4.86	5.49	5.38
14:30-14:45	5.32	6.13	6.06
14:45-15:00	6.89	8.80	8.70

表 3 各订单类型在各证券品种中应用的分布 (2013) 单位:%

产品类别	按笔数统计			按股数统计		
	限价订单	市价委托- 剩余撤消	市价委托-剩 余转限价	限价订单	市价委托-剩余 撤消	市价委托-剩余 转限价
股票	91.97	0.26	0.04	38.41	0.10	0.01
基金	2.56	0.00	0.00	55.04	0.01	0.00
债券	5.18	0.00	0.00	6.43	0.00	0.00

品种合计为 100%

表 4 订单成交分类统计 (2013) 单位:%

	2009 年	2010 年	2011 年	2012 年	2013 年
订单执行比例(股数)	61.82	61.67	58.93	59.66	60.11
撤单比例(笔数)	26.37	25.63	25.45	24.88	24.29
市价订单提交比例(笔数)	0.38	0.36	0.32	0.29	0.28
市价订单提交比例(股数)	0.37	0.34	0.31	0.24	0.27
市价订单委托成交比(股数)	98.21	97.9	96.46	87.03	96.23
机构订单提交比例(笔数)	1.2	2.32	4.39	7.61	8.95
机构订单提交比例(股数)	7.6	9.03	9.81	15.05	14.68
机构成交占比(股数)	7.4	13.63	16.03	10.76	16.55
提交后 10 秒内成交比例	63.5	63.19	60.15	62.38	62.6

表 5 日均订单执行时间分布 (2013) 单位:%

撮合成交时间	2009 年占比	2010 年占比	2011 年占比	2012 年占比	2013 年占比
<1 秒	51.36	51.29	49.16	53.81	52.90
1-10 秒	12.17	11.899	10.99	8.47	8.70
10 秒-1 分钟	14.89	14.759	13.05	8.67	14.65
1 分钟-5 分钟	10.02	10.34	11.29	12.36	10.91
5 分钟-10 分钟	3.82	3.76	4.49	4.48	4.00
10 分钟-30 分钟	3.84	3.99	5.30	5.23	.444
30 分钟-1 小时	1.35	1.41	2.09	1.59	1.60
1 小时-2 小时	1.03	1.08	1.48	2.65	1.18
2 小时以上	1.52	1.48	2.16	2.62	1.62

表 6 日均订单执行价格分布（2013）

执行价格	2009 年占比	2010 年占比	2011 年占比	2012 年占比	2013 年占比
跌(10%以下, 10%]	0.08%	0.06%	0.07%	0.05%	0.09%
跌(10%, 9%]	0.26%	0.25%	0.25%	0.19%	0.33%
跌(9%, 8%]	0.24%	0.20%	0.20%	0.17%	0.27%
跌(8%, 7%]	0.39%	0.32%	0.32%	0.28%	0.42%
跌(7%, 6%]	0.65%	0.57%	0.53%	0.46%	0.68%
跌(6%, 5%]	1.18%	1.04%	0.97%	0.85%	1.16%
跌(5%, 4%]	2.22%	2.05%	2.03%	1.77%	2.21%
跌(4%, 3%]	3.81%	3.70%	3.80%	3.58%	4.21%
跌(3%, 2%]	6.84%	7.14%	7.58%	7.15%	7.72%
跌(2%, 1%]	11.39%	12.71%	13.70%	13.26%	13.02%
跌(1%, 0%]	15.78%	19.27%	20.90%	21.18%	19.10%
涨(0%, 1%]	15.66%	17.28%	18.20%	17.92%	16.13%
涨(1%, 2%]	13.67%	13.00%	12.46%	12.50%	12.03%
涨(2%, 3%]	9.67%	8.27%	7.35%	7.65%	7.83%
涨(3%, 4%]	6.42%	5.16%	4.20%	4.70%	5.11%
涨(4%, 5%]	4.22%	3.08%	2.55%	2.86%	3.21%
涨(5%, 6%]	2.49%	1.83%	1.45%	1.73%	2.04%
涨(6%, 7%]	1.52%	1.13%	0.93%	1.17%	1.39%
涨(7%, 8%]	0.96%	0.75%	0.64%	0.76%	0.96%
涨(8%, 9%]	0.62%	0.53%	0.45%	0.50%	0.65%
涨(9%,10%]	1.16%	1.01%	0.86%	0.77%	1.03%
涨(10%, 10%以上]	0.78%	0.66%	0.59%	0.49%	0.42%

四、结论

市场质量是衡量证券市场核心竞争力的重要指标，对市场质量指标的关注程度则是市场成熟与否的重要标志。本年度报告披露了上海证券交易所交易市场质量和订单执行质量等有关数据。

近年来，沪市证券交易市场质量处于较好水平，衡量流动性和波动性的市场质量指数 2013 年达到 327 点，与 2012 年的 330 点基本持平，其中，相对买卖价差、价格冲击成本比 2012 年均有所下降，流动性指数比 2012 年上升 22%，市场深度提高 25%。2013 年沪市超额波动率和收益波动率与 2012 年基础持平，日内波动率上升 5 个基点。

在订单执行质量方面，2013 年订单每笔申报金额和成交金额较 2012 年有所下降。沪市平均每天的有效报单笔数相比 2012 年略有下降，但实际成交笔数比 2012 年有较大幅增长。从投资者类型的订单成交情况来看，机构投资者提交的订单占比与 2012 年基本持平，但成交额占比提高了近 6 个百分点。其余指标均与 2012 年基本持平。

附录一 各项指标定义

本报告以上海证券交易所所有上市股票（A、B 股）为考察对象，证券交易市场质量指标的样本区间为 2013 年全年。为分析交易市场质量指标，我们对所有股票每日每笔订单达到时的买卖订单队列进行了重构，并在此基础上进行有关指标的计算。每日计算时间区间为 9:30—11:30 和 13:00—15:00，订单簿重构时间从第一笔进入交易系统订单开始，对 9:30 之前只生成一次订单簿队列快照，对 9:30 以后进入交易系统的所有订单按每 30 秒生成一次新队列快照。对 2000 年和 2005 年各项指标沿用《上证所市场质量报告（2006）》中的数据和计算方法。

各指标的定义与计算方法如下。

1. 买卖价差。买卖价差衡量最佳（高）买价和最佳（低）卖价之间的差额，买卖价差越高，潜在的订单执行成本越高。设 P_{Ait} 为股票 i 在 t 时刻的最佳卖出价格， P_{Bit} 为股票 i 在 t 时刻的最佳买入价格， P_{Mit} 为股票 i 在 t 时刻最佳买价和最佳卖价的均值（中点），即

$$P_{Mit} = (P_{Ait} + P_{Bit}) / 2$$

则股票 i 在 t 时刻的买卖价差为：

$$\text{绝对买卖价差} = (P_{Ait} - P_{Bit})$$

$$\text{相对买卖价差} = (P_{Ait} - P_{Bit}) / P_{Mit} \cdot 100\%$$

股票 i 在 d 日按时间加权的平均买卖价差为：

$$\text{绝对买卖价差} = \sum_{t=1}^n (P_{Ait} - P_{Bit}) \cdot W_{it}$$

$$\text{相对买卖价差} = \sum_{t=1}^n \frac{(P_{Ait} - P_{Bit})}{P_{Mit}} \cdot W_{it} \cdot 100\%$$

其中， W_{it} 为股票 i 在 t 时刻价差延续时间占股票 i 当日总交易时间的比重。

2. 有效价差。有效价差衡量订单实际成交价格 and 订单达到时买卖价差中点之间的差额，有效价差越高，订单的实际执行成本越高。设 P_{it} 为股票 i 在 t 时刻提交订单的加权平均价格， P_{Mit} 为股票 i 在 t 时刻最佳买价和最佳卖价的均值，则股票 i 在 t 时刻的有效价差为：

$$\text{绝对有效价差} = 2 \cdot |P_{it} - P_{Mit}|$$

$$\text{相对有效价差} = (2 \cdot |P_{it} - P_{Mit}|) / P_{Mit} \cdot 100\%$$

股票 i 在 d 日按时间加权的平均有效价差为：

$$\text{绝对有效价差} = \sum_{t=1}^n 2|P_{it} - P_{Mit}| \cdot W_{it}$$

$$\text{相对有效价差} = \sum_{t=1}^n \frac{2|P_{it} - P_{Mit}|}{P_{Mit}} \cdot W_{it} \cdot 100\%$$

其中， W_{it} 为股票 i 在 t 时刻价差延续时间占当日股票 i 总交易时间的比重。

3. 价格冲击指数。价格冲击指数衡量一定金额（或股票数量）的交易对市场价格的冲击程度，价格冲击指数越高，交易成本越高。设 $A_1, A_2, A_3 \dots A_k$ 分别表示股票 i 在 t 时刻限价订单簿中的多个卖出价格，且 $A_1 < A_2 < A_3 < \dots < A_k$ ， $S_1, S_2, S_3 \dots S_k$ 分别表示 $A_1, A_2, A_3 \dots A_k$ 所对应的数量； $B_1, B_2, B_3 \dots B_k$ 分别表示股票 i 在 t 时刻限价订单簿中的多个买入价格，其中 $B_1 > B_2 > B_3 > \dots > B_k$ ， $D_1, D_2, D_3 \dots D_k$ 分别表示 $B_1, B_2, B_3 \dots B_k$ 所对应的数量，则在 t 时刻购买 Q 金额股票 i 的价格冲击指数为：

$$\frac{Q / \left[\sum_{j=1}^{k-1} S_j + (Q - \sum_{j=1}^{k-1} S_j \cdot A_j) / A_k \right] - (A_1 + B_1) / 2}{(A_1 + B_1) / 2},$$

其中 $\sum_{j=1}^k S_j A_j > Q \geq \sum_{j=1}^{k-1} S_j A_j$ (若 K 不存在, 则用空值表示)

卖出 Q 金额股票 i 的价格冲击指数为：

$$\frac{\left| Q / \left[\sum_{j=1}^{k-1} D_j + (Q - \sum_{j=1}^{k-1} D_j \cdot B_j) / B_k \right] - (A_1 + B_1) / 2 \right|}{(A_1 + B_1) / 2},$$

其中 $\sum_{j=1}^k D_j B_j > Q \geq \sum_{j=1}^{k-1} D_j B_j$ (若 K 不存在, 则用空值表示)

t 时刻买卖 Q 金额股票 i 的价格冲击指数为买入的价格冲击指数和卖出的价格冲击指数之平均值。

市场冲击成本衡量即时成交的价格变化, 由流动性溢价和逆向价格运动成本两部分组成。流动性溢价即买卖价差, 对买单来说, 流动性溢价是当前最佳卖价与最佳买卖价中点的差额, 对卖单来说, 则是当前最佳买价与最佳买卖价中点的差额。如果订单数量超过最佳买(卖)价位上的数量, 则该订单将分多次撮合, 并导致价格出现逆向变化(买入价格上升, 卖出价格下降), 即逆向价格运动成本。

4. 流动性指数。 流动性指数, 也可称为价格影响成本指数, 是指使价格发生一定程度变化所需要的交易金额, 越大, 市场流动性越好。设 $A_1, A_2, A_3 \dots A_k$ 分别表示股票 i 在 t 时刻限价订单簿中的多个卖出价格, 且 $A_1 < A_2 < A_3 < \dots < A_k$, $S_1, S_2, S_3 \dots S_k$ 分别表示 $A_1, A_2, A_3 \dots A_k$ 所对应的数量; $B_1, B_2, B_3 \dots B_k$ 分别表示股票 i 在 t 时刻限价订单簿中的多个买入价格, 其中 $B_1 > B_2 > B_3 > \dots > B_k$, $D_1, D_2, D_3 \dots D_k$ 分别表示 $B_1, B_2, B_3 \dots B_k$ 所对应的数量, 则在 t 时刻使价格上升 Δ 的流动性指数为:

$$\sum_{j=1}^{k-1} S_j A_j + A_k, \text{ 其中 } k = \{\min(m) \mid \frac{|A_m - A_1|}{A_1} \geq \Delta\}$$

使价格下降 Δ 的流动性指数为:

$$\sum_{j=1}^{k-1} D_j B_j + B_k, \text{ 其中 } k = \{\min(m) \mid \frac{|B_m - B_1|}{B_1} \geq \Delta\}$$

t 时刻价格上升或下降 1% 的流动性指数为上升的流动性指数和下降的流动性指数之平均值。

5. 订单 / 市场深度。 市场深度按各个报价档位累积买卖订单金额计算。我们计算了五档和十档两种订单深度指标。五档订单深度即订单簿

中最高五个买价（买一到买五）上订单金额与最低五个卖价（卖一到卖五）上订单金额总和；十档订单深度即订单簿中最高十个买价（买一到买十）上订单金额与最低十个卖价（卖一到卖十）上订单金额总和。

6. 日内波动率。日内每 5 分钟的相对波动率。计算方法是：

设 H_i 为第 i 个 5 分钟内某证券的最高成交价格， L_i 为第 i 个 5 分钟内某证券的最低成交价格，则该证券的日内波动率为：
$$\frac{1}{n} \sum_{i=1}^n \frac{(H_i - L_i)}{H_i}$$

日内波动率越大，价格在区间内波动越大。

7. 超额波动率。超额波动是衡量由噪音交易、交易机制等因素导致的临时波动性的近似指标。超额波动率等于日间波动率和日内波动率的差额。计算方法是：

设 H_{it} 为股票 i 在 t 日的最高价， L_{it} 为股票 i 在 t 日的最低价， P_{it} 为股票 i 在 t 日的收盘价， P_{it-1} 为股票 i 在 $t-1$ 日的收盘价，则股票 i 在 t 日的超额波动率为：
$$|(H_{it} - L_{it})/P_{it-1} - (P_{it} - P_{it-1})/P_{it-1}|$$

超额波动率越大，说明临时波动性越大。

8. 收益波动率。日内 5 分钟内收益率标准差。收益波动率越大，价格波动越大。

9. 市场质量综合指数。

$$= \left(\frac{1 / \text{相对有效价差}}{\text{基期}} \times \text{权重} + \frac{1 / \text{超额波动率}}{\text{基期}} \times \text{权重} \right) \times 100\%$$

本研究将流动性用相对有效价差的倒数表示，波动性用超额波动率的倒数表示，并进行标准化处理，以 2000 年为基准，设为 100。权重设为等权重，在本报告中各取 50%。该值越大，交易市场质量也就越好。

附录二 个股市场质量指标统计（2013 年度）

序号	证券代码	证券名称	价格冲击 指数(基点)	流动性指 数(万元)	大宗交易 成本(基点)	五档订单 深度(万元)	十档订单 深度(万元)	相对买卖 价差(基点)	相对有效价 差(基点)	日内波动 率(基点)	超额波动 率(基点)	收益波动 率(基点)
1	600000	浦发银行	6	4525	12	4139	8673	11	26	41	22	27
2	600004	白云机场	12	234	100	327	590	16	26	29	15	20
3	600005	武钢股份	22	562	51	1719	2477	40	51	51	30	33
4	600006	东风汽车	20	225	111	635	1051	34	51	47	26	32
5	600007	中国国贸	27	72	209	78	155	22	33	32	12	32
6	600008	首创股份	10	561	51	730	1537	16	37	56	27	42
7	600009	上海机场	10	467	61	327	686	12	23	41	21	29
8	600010	包钢股份	12	1098	33	2179	4164	23	42	48	27	31
9	600011	华能国际	11	798	39	1259	2279	18	31	44	25	27
10	600012	皖通高速	21	145	138	314	517	27	37	28	13	23
11	600015	华夏银行	7	1263	24	1336	2692	12	25	40	21	26
12	600016	民生银行	6	4580	13	4463	9305	11	30	47	24	32
13	600017	日照港	22	259	89	841	1261	38	50	47	27	32
14	600018	上港集团	18	647	57	1493	2709	32	50	55	30	39
15	600019	宝钢股份	13	1499	29	2971	4658	23	33	38	22	23
16	600020	中原高速	27	157	141	488	699	44	57	42	21	33
17	600021	上海电力	15	262	95	507	891	23	37	40	21	29
18	600022	山东钢铁	29	431	64	1627	2147	55	64	63	36	41
19	600023	浙能电力	9	719	41	902	1889	15	30	85	43	64
20	600026	中海发展	17	154	141	320	574	25	40	42	21	32
21	600027	华电国际	17	686	56	1702	2699	29	44	52	30	32
22	600028	中国石化	11	1798	23	3077	5604	19	33	41	23	24
23	600029	南方航空	17	653	45	1852	3020	32	45	50	28	31
24	600030	中信证券	5	3055	14	2095	4624	9	28	46	23	31

序号	证券代码	证券名称	价格冲击 指数(基点)	流动性指 数(万元)	大宗交易 成本(基点)	五档订单 深度(万元)	十档订单 深度(万元)	相对买卖 价差(基点)	相对有效价 差(基点)	日内波动 率(基点)	超额波动 率(基点)	收益波动 率(基点)
25	600031	三一重工	8	1084	30	1148	2355	13	29	42	22	30
26	600033	福建高速	25	438	68	1317	1712	47	55	48	27	32
27	600035	楚天高速	27	102	163	268	431	33	49	35	15	31
28	600036	招商银行	6	3200	15	2432	5208	9	26	42	22	27
29	600037	歌华有线	11	297	83	363	747	15	32	50	25	35
30	600038	哈飞股份	9	357	67	172	365	10	28	50	21	41
31	600039	四川路桥	12	321	83	448	891	17	34	45	21	34
32	600048	保利地产	7	1782	22	1440	3094	11	28	48	25	32
33	600050	中国联通	15	2963	21	7350	11871	29	44	46	28	27
34	600051	宁波联合	15	181	138	224	448	17	32	38	17	31
35	600052	浙江广厦	24	98	184	248	444	30	49	43	20	34
36	600053	中江地产	29	67	217	95	190	25	41	45	18	40
37	600054	黄山旅游	14	140	150	126	252	13	24	31	14	24
38	600055	华润万东	20	97	189	96	195	17	33	45	17	39
39	600056	中国医药	9	290	85	170	350	10	21	36	15	30
40	600057	象屿股份	18	158	141	308	609	24	46	57	27	44
41	600058	五矿发展	9	332	78	212	439	9	27	47	21	37
42	600059	古越龙山	9	375	70	315	656	11	27	41	19	31
43	600060	海信电器	8	593	48	455	962	10	29	50	24	36
44	600061	中纺投资	21	98	197	169	334	23	44	58	26	47
45	600062	华润双鹤	9	374	67	207	427	10	21	40	18	30
46	600063	皖维高新	23	410	69	1324	1989	44	58	56	32	36
47	600064	南京高科	12	207	109	180	377	13	26	38	17	29
48	600066	宇通客车	8	498	56	292	598	9	22	43	20	33

序号	证券代码	证券名称	价格冲击 指数(基点)	流动性指 数(万元)	大宗交易 成本(基点)	五档订单 深度(万元)	十档订单 深度(万元)	相对买卖 价差(基点)	相对有效价 差(基点)	日内波动 率(基点)	超额波动 率(基点)	收益波动 率(基点)
49	600067	冠城大通	10	522	50	649	1339	15	33	48	24	33
50	600068	葛洲坝	12	775	39	1464	2539	22	35	38	22	23
51	600069	银鸽投资	17	164	139	296	553	23	38	41	20	31
52	600070	浙江富润	16	134	152	155	317	16	32	40	17	32
53	600071	凤凰光学	22	87	202	126	246	20	38	44	18	37
54	600072	中船股份	10	239	103	187	380	11	28	48	21	40
55	600073	上海梅林	13	250	104	282	624	16	37	58	27	44
56	600074	*ST中达	19	169	141	358	680	26	43	44	20	36
57	600075	新疆天业	16	163	139	221	435	17	35	43	19	35
58	600076	青鸟华光	23	94	203	192	374	26	45	56	26	47
59	600077	宋都股份	15	221	120	364	722	21	41	54	25	40
60	600078	澄星股份	11	290	88	370	746	16	32	40	19	29
61	600079	人福医药	11	375	71	234	469	13	25	45	21	35
62	600080	金花股份	14	180	122	211	434	16	33	46	22	35
63	600081	东风科技	22	87	192	115	223	19	35	38	15	35
64	600082	海泰发展	17	186	124	375	748	23	44	54	27	42
65	600083	博信股份	33	61	256	98	199	30	47	43	16	42
66	600084	中葡股份	20	119	172	226	436	24	40	44	21	33
67	600085	同仁堂	6	682	40	309	656	8	22	39	18	29
68	600086	东方金钰	9	302	78	173	350	10	25	45	19	36
69	600087	*ST长油	36	409	73	2072	3141	68	85	82	48	53
70	600088	中视传媒	13	215	114	165	335	13	33	53	23	43
71	600089	特变电工	8	958	33	960	2091	13	34	52	26	37
72	600090	啤酒花	14	157	146	206	412	16	31	39	18	30

序号	证券代码	证券名称	价格冲击 指数(基点)	流动性指 数(万元)	大宗交易 成本(基点)	五档订单 深度(万元)	十档订单 深度(万元)	相对买卖 价差(基点)	相对有效价 差(基点)	日内波动 率(基点)	超额波动 率(基点)	收益波动 率(基点)
73	600091	ST 明科	31	57	190	123	231	29	43	33	12	33
74	600093	禾嘉股份	22	89	208	139	278	22	39	38	16	33
75	600094	大名城	18	144	156	228	458	21	37	46	21	36
76	600095	哈高科	18	139	150	246	477	21	38	43	20	33
77	600096	云天化	11	237	98	229	448	12	24	39	19	29
78	600097	开创国际	16	119	150	107	214	15	28	38	16	33
79	600098	广州发展	14	254	99	404	756	19	33	38	19	28
80	600099	林海股份	28	61	215	107	200	25	38	35	14	31
81	600100	同方股份	8	763	39	808	1735	13	32	49	26	33
82	600101	明星电力	11	220	100	230	461	13	28	40	18	32
83	600103	青山纸业	24	191	116	632	1060	39	56	51	28	35
84	600104	上汽集团	6	1206	27	729	1579	8	25	44	22	30
85	600105	永鼎股份	17	124	161	194	386	19	37	46	21	35
86	600106	重庆路桥	17	285	88	683	1169	28	43	44	24	32
87	600107	美尔雅	14	194	122	249	504	17	35	44	20	34
88	600108	亚盛集团	10	697	49	783	1688	15	36	58	29	41
89	600109	国金证券	7	486	54	325	666	9	26	52	24	39
90	600110	中科英华	11	437	63	667	1358	18	34	50	26	36
91	600111	包钢稀土	3	2110	16	680	1427	5	20	43	18	34
92	600112	天成控股	12	335	76	276	608	14	32	44	20	35
93	600113	浙江东日	11	247	97	237	491	12	32	58	26	46
94	600114	东睦股份	13	178	134	162	336	13	31	48	21	39
95	600115	东方航空	19	448	64	1286	2117	35	50	55	31	35
96	600116	三峡水利	10	259	100	228	466	11	27	38	16	31

序号	证券代码	证券名称	价格冲击 指数(基点)	流动性指 数(万元)	大宗交易 成本(基点)	五档订单 深度(万元)	十档订单 深度(万元)	相对买卖 价差(基点)	相对有效价 差(基点)	日内波动 率(基点)	超额波动 率(基点)	收益波动 率(基点)
97	600117	西宁特钢	19	130	160	264	477	25	40	41	20	30
98	600118	中国卫星	6	701	39	394	846	8	26	55	24	43
99	600119	长江投资	17	170	140	169	345	18	37	60	25	51
100	600120	浙江东方	9	356	67	274	581	11	28	51	24	39
101	600121	郑州煤电	19	105	172	157	300	19	35	41	19	32
102	600122	宏图高科	16	257	94	561	995	26	43	45	24	31
103	600123	兰花科创	6	715	39	427	896	8	21	40	18	30
104	600125	铁龙物流	11	430	60	624	1275	17	34	50	26	33
105	600126	杭钢股份	25	97	198	245	441	31	54	52	24	41
106	600127	金健米业	17	175	133	340	629	23	39	43	22	32
107	600128	弘业股份	15	137	155	148	297	15	30	42	19	33
108	600129	太极集团	14	152	141	174	357	15	33	44	20	34
109	600130	波导股份	21	164	137	432	785	31	52	54	28	39
110	600131	岷江水电	16	165	141	290	526	21	37	37	18	28
111	600132	重庆啤酒	7	434	59	259	531	8	17	32	14	25
112	600133	东湖高新	14	214	112	331	657	18	38	50	24	38
113	600135	乐凯胶片	14	169	137	186	388	15	33	53	23	41
114	600136	道博股份	24	121	180	137	257	22	36	40	17	35
115	600137	浪莎股份	23	66	238	76	147	19	29	36	14	32
116	600138	中青旅	10	334	71	218	454	11	25	41	19	30
117	600139	西部资源	13	214	115	242	498	15	32	46	21	35
118	600141	兴发集团	8	368	69	243	504	9	22	35	15	27
119	600143	金发科技	12	548	52	869	1765	19	35	51	27	34
120	600145	国创能源	20	148	162	278	533	25	43	46	22	36

序号	证券代码	证券名称	价格冲击 指数(基点)	流动性指 数(万元)	大宗交易 成本(基点)	五档订单 深度(万元)	十档订单 深度(万元)	相对买卖 价差(基点)	相对有效价 差(基点)	日内波动 率(基点)	超额波动 率(基点)	收益波动 率(基点)
121	600146	大元股份	13	180	123	162	332	14	30	46	20	36
122	600148	长春一东	36	51	235	69	137	28	42	39	15	37
123	600149	廊坊发展	16	208	122	253	534	19	38	48	21	38
124	600150	中国船舶	7	503	54	264	534	8	21	42	18	34
125	600151	航天机电	11	361	83	418	883	15	34	53	25	40
126	600152	维科精华	22	88	194	168	329	24	43	50	23	39
127	600153	建发股份	11	462	60	593	1216	16	33	47	24	31
128	600155	*ST宝硕	31	70	185	193	361	35	51	37	15	35
129	600156	华升股份	25	96	190	206	379	28	48	46	21	38
130	600157	永泰能源	9	634	44	783	1597	15	32	53	27	37
131	600158	中体产业	12	330	78	462	979	17	41	62	31	45
132	600159	大龙地产	26	103	168	326	550	36	50	43	22	32
133	600160	巨化股份	11	325	77	401	811	15	29	44	22	32
134	600161	天坛生物	9	343	76	206	429	9	26	49	21	38
135	600162	香江控股	16	168	138	242	495	19	42	60	28	46
136	600163	福建南纸	17	228	102	493	940	25	43	51	25	38
137	600165	新日恒力	15	213	140	298	551	17	31	38	17	30
138	600166	福田汽车	11	537	51	816	1563	18	33	44	23	30
139	600167	联美控股	17	110	174	105	210	15	26	36	14	31
140	600168	武汉控股	15	149	146	192	392	17	34	45	20	36
141	600169	太原重工	19	383	73	1064	1909	33	53	59	33	38
142	600170	上海建工	10	541	52	705	1400	15	29	41	21	30
143	600171	上海贝岭	15	192	125	289	588	19	41	57	27	43
144	600172	黄河旋风	12	251	93	328	669	16	32	44	22	32

序号	证券代码	证券名称	价格冲击 指数(基点)	流动性指 数(万元)	大宗交易 成本(基点)	五档订单 深度(万元)	十档订单 深度(万元)	相对买卖 价差(基点)	相对有效价 差(基点)	日内波动 率(基点)	超额波动 率(基点)	收益波动 率(基点)
145	600173	卧龙地产	22	136	149	364	606	32	47	42	21	31
146	600175	美都控股	17	358	74	799	1505	28	49	55	28	40
147	600176	中国玻纤	12	311	99	365	714	15	31	40	19	30
148	600177	雅戈尔	10	398	62	494	984	15	30	44	23	29
149	600178	东安动力	19	133	159	211	401	21	40	46	21	36
150	600179	黑化股份	16	189	134	288	563	19	39	49	23	37
151	600180	瑞茂通	17	161	156	174	363	17	35	51	22	44
152	600182	S佳通	12	180	115	165	343	12	26	37	16	31
153	600183	生益科技	17	206	120	377	725	22	40	43	22	31
154	600184	光电股份	17	163	142	117	235	17	32	49	20	42
155	600185	格力地产	17	149	147	202	410	19	41	56	26	44
156	600186	莲花味精	21	277	100	818	1332	35	54	49	27	34
157	600187	国中水务	11	396	69	439	902	14	32	49	22	38
158	600188	兖州煤业	9	313	83	232	471	10	25	43	20	34
159	600189	吉林森工	15	161	152	209	420	17	33	46	21	36
160	600190	锦州港	20	129	169	303	524	27	43	38	17	32
161	600191	华资实业	18	121	168	180	350	20	33	37	17	29
162	600192	长城电工	17	157	162	219	418	18	34	39	17	32
163	600193	创兴资源	11	247	100	231	473	13	29	47	21	36
164	600195	中牧股份	11	231	103	176	363	11	24	40	18	31
165	600196	复星医药	7	699	41	480	1033	10	28	49	24	35
166	600197	伊力特	11	247	96	204	417	12	26	43	20	33
167	600198	大唐电信	10	269	90	208	433	11	33	61	27	48
168	600199	金种子酒	7	471	52	324	671	9	24	45	20	35

序号	证券代码	证券名称	价格冲击 指数(基点)	流动性指 数(万元)	大宗交易 成本(基点)	五档订单 深度(万元)	十档订单 深度(万元)	相对买卖 价差(基点)	相对有效价 差(基点)	日内波动 率(基点)	超额波动 率(基点)	收益波动 率(基点)
169	600200	江苏吴中	7	696	44	504	1081	10	31	57	25	45
170	600201	金宇集团	13	265	91	173	365	14	26	41	17	34
171	600202	哈空调	18	141	172	224	425	20	37	42	19	34
172	600203	福日电子	18	111	156	159	308	19	34	42	19	34
173	600206	有研硅股	13	176	130	131	268	13	29	48	20	40
174	600207	安彩高科	21	125	186	242	457	24	45	53	25	42
175	600208	新潮中宝	18	411	66	1028	1853	30	49	56	32	36
176	600209	罗顿发展	9	446	60	392	830	11	34	68	31	53
177	600210	紫江企业	19	237	101	606	974	31	46	43	23	30
178	600211	西藏药业	20	99	185	79	160	17	29	35	13	33
179	600212	江泉实业	24	126	155	343	606	34	52	48	24	36
180	600213	亚星客车	28	63	228	97	190	23	39	42	17	38
181	600215	长春经开	23	99	186	204	361	26	39	36	16	29
182	600216	浙江医药	7	462	52	272	562	8	18	35	16	27
183	600217	秦岭水泥	14	305	98	501	1004	20	42	55	27	43
184	600218	全柴动力	11	241	110	240	493	13	30	48	21	38
185	600219	南山铝业	12	425	60	665	1221	18	29	37	21	23
186	600220	江苏阳光	24	201	117	657	1052	40	55	53	29	36
187	600221	海南航空	20	1097	47	3420	4969	38	49	55	32	34
188	600222	太龙药业	17	153	137	252	508	20	39	43	20	33
189	600223	鲁商置业	22	118	175	237	455	26	46	48	23	37
190	600225	天津松江	23	109	188	206	393	25	51	62	28	51
191	600226	升华拜克	15	165	149	252	490	19	37	48	22	37
192	600227	赤天化	21	163	143	425	657	32	45	42	23	29

序号	证券代码	证券名称	价格冲击 指数(基点)	流动性指 数(万元)	大宗交易 成本(基点)	五档订单 深度(万元)	十档订单 深度(万元)	相对买卖 价差(基点)	相对有效价 差(基点)	日内波动 率(基点)	超额波动 率(基点)	收益波动 率(基点)
193	600228	昌九生化	9	330	70	161	336	10	29	67	29	57
194	600229	青岛碱业	15	196	124	315	633	19	40	50	24	37
195	600230	沧州大化	11	210	113	157	321	11	25	40	15	34
196	600231	凌钢股份	21	136	164	327	570	29	44	47	24	33
197	600232	金鹰股份	24	84	204	167	320	25	44	44	20	36
198	600233	大杨创世	15	127	160	128	257	14	28	43	19	36
199	600234	*ST天龙	26	80	167	162	303	27	40	34	14	32
200	600235	民丰特纸	21	123	152	170	332	21	38	43	19	37
201	600236	桂冠电力	20	199	120	491	802	30	43	39	20	29
202	600237	铜峰电子	18	139	154	217	433	20	38	44	20	33
203	600238	海南椰岛	12	223	105	261	532	15	30	45	21	35
204	600239	云南城投	13	294	91	419	848	18	36	45	22	33
205	600240	华业地产	15	341	79	675	1370	24	45	57	29	40
206	600241	时代万恒	25	81	193	125	231	22	38	41	17	36
207	600242	中昌海运	25	76	212	131	255	23	41	45	20	39
208	600243	青海华鼎	18	185	151	291	543	21	39	47	23	35
209	600246	万通地产	24	130	174	334	587	31	49	45	22	34
210	600247	成城股份	16	180	137	311	627	21	42	53	27	40
211	600248	延长化建	19	109	234	135	274	18	35	40	18	32
212	600249	两面针	20	110	176	186	369	22	38	43	19	35
213	600250	南纺股份	31	70	232	115	245	28	46	47	19	44
214	600251	冠农股份	9	321	88	200	411	10	23	40	18	32
215	600252	中恒集团	7	683	41	444	983	10	25	47	22	35
216	600253	天方药业	14	190	119	276	522	17	32	41	20	30

序号	证券代码	证券名称	价格冲击 指数(基点)	流动性指 数(万元)	大宗交易 成本(基点)	五档订单 深度(万元)	十档订单 深度(万元)	相对买卖 价差(基点)	相对有效价 差(基点)	日内波动 率(基点)	超额波动 率(基点)	收益波动 率(基点)
217	600255	鑫科材料	18	139	150	214	416	20	38	42	19	34
218	600256	广汇能源	6	1199	28	784	1729	10	26	51	25	37
219	600257	大湖股份	12	314	82	395	842	16	34	50	24	36
220	600258	首旅酒店	16	135	149	114	230	15	29	40	17	34
221	600259	广晟有色	6	532	48	183	356	6	20	46	18	40
222	600260	凯乐科技	10	340	75	383	773	14	30	48	23	35
223	600261	阳光照明	14	200	116	195	390	15	36	57	26	45
224	600262	北方股份	14	120	156	98	193	13	24	36	14	30
225	600265	*ST 景谷	36	58	217	84	180	33	44	33	11	35
226	600266	北京城建	11	278	83	249	499	12	25	42	21	30
227	600267	海正药业	9	429	59	282	593	10	24	46	22	34
228	600268	国电南自	19	128	172	204	412	21	38	47	23	35
229	600269	赣粤高速	19	301	83	782	1145	32	41	36	20	25
230	600270	外运发展	14	192	119	214	431	16	34	50	24	37
231	600271	航天信息	6	606	42	360	760	8	22	45	21	32
232	600272	开开实业	16	117	162	117	236	15	32	48	20	41
233	600273	华芳纺织	19	112	169	177	347	21	37	46	20	39
234	600275	武昌鱼	15	183	124	285	580	19	37	51	24	39
235	600276	恒瑞医药	7	613	45	269	558	9	19	42	20	32
236	600277	亿利能源	13	206	118	252	519	16	37	56	25	45
237	600278	东方创业	17	134	155	155	305	17	36	53	23	45
238	600279	重庆港九	24	76	196	106	208	20	37	38	15	35
239	600280	中央商场	16	159	147	117	233	16	29	47	19	43
240	600281	太化股份	29	65	230	118	224	27	43	37	15	34

序号	证券代码	证券名称	价格冲击 指数(基点)	流动性指 数(万元)	大宗交易 成本(基点)	五档订单 深度(万元)	十档订单 深度(万元)	相对买卖 价差(基点)	相对有效价 差(基点)	日内波动 率(基点)	超额波动 率(基点)	收益波动 率(基点)
241	600282	南钢股份	32	107	185	382	546	49	62	45	21	36
242	600283	钱江水利	14	165	142	197	386	15	32	39	17	32
243	600284	浦东建设	10	297	84	280	562	12	28	44	20	35
244	600285	羚锐制药	11	258	93	227	476	12	27	42	18	33
245	600287	江苏舜天	18	121	153	169	331	19	33	41	18	33
246	600288	大恒科技	12	212	111	257	532	15	35	52	25	39
247	600289	亿阳信通	11	293	82	350	740	15	35	57	27	42
248	600290	华仪电气	18	132	153	218	423	21	38	45	21	36
249	600291	西水股份	16	152	152	166	349	17	37	56	25	44
250	600292	中电远达	9	296	81	178	368	10	26	50	20	42
251	600293	三峡新材	14	255	119	353	691	18	33	40	19	31
252	600295	鄂尔多斯	18	113	159	146	276	17	28	34	15	27
253	600297	美罗药业	15	163	136	236	454	17	32	37	17	29
254	600298	安琪酵母	9	276	81	178	360	10	23	44	18	35
255	600299	蓝星新材	26	75	212	132	253	25	41	43	19	36
256	600300	维维股份	12	413	67	679	1311	19	37	46	23	33
257	600301	*ST 南化	20	115	165	161	343	21	42	57	25	47
258	600302	标准股份	29	72	201	169	293	29	45	40	18	34
259	600303	曙光股份	16	213	111	432	843	24	44	51	25	38
260	600305	恒顺醋业	19	128	180	96	193	19	34	49	19	44
261	600306	商业城	19	119	172	139	277	18	32	35	14	30
262	600307	酒钢宏兴	23	164	146	466	720	35	49	39	20	29
263	600308	华泰股份	20	213	108	567	860	33	44	39	21	28
264	600309	万华化学	7	672	42	378	798	9	24	44	22	31

序号	证券代码	证券名称	价格冲击 指数(基点)	流动性指 数(万元)	大宗交易 成本(基点)	五档订单 深度(万元)	十档订单 深度(万元)	相对买卖 价差(基点)	相对有效价 差(基点)	日内波动 率(基点)	超额波动 率(基点)	收益波动 率(基点)
265	600310	桂东电力	15	131	153	124	257	15	28	39	16	31
266	600311	荣华实业	13	263	107	368	708	17	31	40	20	29
267	600312	平高电气	10	370	67	354	745	13	32	48	22	36
268	600313	中农资源	15	169	132	200	415	17	35	53	24	42
269	600315	上海家化	8	591	51	250	506	10	20	44	20	35
270	600316	洪都航空	9	402	61	248	515	10	27	56	25	42
271	600317	营口港	24	95	182	240	398	30	44	33	15	28
272	600318	巢东股份	12	192	127	186	366	13	29	47	20	38
273	600319	*ST 亚星	30	56	254	124	221	29	42	37	15	33
274	600320	振华重工	18	306	83	791	1381	31	48	46	25	32
275	600321	国栋建设	24	405	72	1287	1914	44	58	54	31	35
276	600322	天房发展	19	246	98	645	1119	31	47	47	25	32
277	600323	瀚蓝环境	13	199	119	250	511	15	31	41	19	32
278	600325	华发股份	11	314	79	406	807	16	31	42	21	30
279	600326	西藏天路	14	167	142	217	417	16	29	37	17	30
280	600327	大东方	17	153	141	295	556	23	40	49	24	36
281	600328	兰太实业	17	124	156	173	337	17	31	37	17	29
282	600329	中新药业	10	276	85	212	431	11	27	43	19	34
283	600330	天通股份	15	201	124	300	616	19	41	56	26	42
284	600331	宏达股份	15	204	120	354	663	21	35	44	23	31
285	600332	白云山	5	850	34	307	635	7	24	52	21	42
286	600333	长春燃气	12	221	106	247	493	14	29	40	18	31
287	600335	国机汽车	21	116	181	114	227	20	36	50	20	43
288	600336	澳柯玛	13	304	95	470	922	18	36	52	25	39

序号	证券代码	证券名称	价格冲击 指数(基点)	流动性指 数(万元)	大宗交易 成本(基点)	五档订单 深度(万元)	十档订单 深度(万元)	相对买卖 价差(基点)	相对有效价 差(基点)	日内波动 率(基点)	超额波动 率(基点)	收益波动 率(基点)
289	600337	美克股份	14	241	118	331	693	18	35	49	24	37
290	600338	西藏珠峰	16	118	181	127	253	15	30	49	22	41
291	600339	天利高新	20	131	148	276	511	25	43	48	24	36
292	600340	华夏幸福	10	343	75	186	379	11	22	47	20	39
293	600343	航天动力	12	178	128	147	299	12	28	49	20	40
294	600345	长江通信	15	139	139	112	226	14	28	45	18	39
295	600346	大橡塑	26	67	215	104	198	23	37	35	14	32
296	600348	阳泉煤业	8	476	56	407	843	11	27	45	22	33
297	600350	山东高速	21	173	127	445	665	33	43	31	15	25
298	600351	亚宝药业	14	197	117	292	580	18	35	42	21	31
299	600352	浙江龙盛	10	435	63	384	830	13	35	55	27	39
300	600353	旭光股份	16	137	153	189	373	17	33	44	20	35
301	600354	敦煌种业	12	301	93	388	806	16	36	53	25	41
302	600355	精伦电子	20	103	187	183	360	23	42	53	25	42
303	600356	恒丰纸业	26	78	195	122	228	23	33	27	11	24
304	600358	*ST 联合	25	92	166	225	378	29	45	33	14	29
305	600359	新农开发	21	99	179	144	278	20	40	54	23	46
306	600360	华微电子	18	176	134	366	700	25	45	47	23	34
307	600361	华联综超	19	134	148	270	473	24	36	36	18	27
308	600362	江西铜业	5	750	36	392	806	7	19	34	16	26
309	600363	联创光电	14	167	138	205	413	15	32	44	20	34
310	600365	通葡股份	21	97	183	109	214	19	32	39	16	34
311	600366	宁波韵升	7	461	55	277	583	8	24	43	19	34
312	600367	红星发展	15	135	167	140	278	15	31	42	18	35

序号	证券代码	证券名称	价格冲击 指数(基点)	流动性指 数(万元)	大宗交易 成本(基点)	五档订单 深度(万元)	十档订单 深度(万元)	相对买卖 价差(基点)	相对有效价 差(基点)	日内波动 率(基点)	超额波动 率(基点)	收益波动 率(基点)
313	600368	五洲交通	18	176	128	379	717	24	44	51	25	38
314	600369	西南证券	11	340	75	334	715	14	31	56	27	39
315	600370	三房巷	30	54	269	114	202	28	40	33	14	30
316	600371	万向德农	14	138	147	126	250	13	27	39	16	34
317	600372	中航电子	11	357	71	226	465	12	27	54	23	44
318	600373	中文传媒	9	279	83	181	369	10	26	50	22	39
319	600375	华菱星马	16	133	146	135	272	15	31	45	19	37
320	600376	首开股份	11	434	59	581	1111	16	30	45	24	30
321	600377	宁沪高速	15	186	112	319	529	20	28	24	11	19
322	600378	天科股份	13	160	140	157	320	14	30	48	21	38
323	600379	宝光股份	23	76	228	102	199	21	35	41	17	35
324	600380	健康元	16	211	114	377	736	22	40	46	23	33
325	600381	*ST 贤成	20	702	50	2001	3619	36	56	60	34	42
326	600382	广东明珠	15	150	141	201	393	17	31	35	16	28
327	600383	金地集团	10	1040	32	1408	2898	16	39	55	29	36
328	600385	*ST 金泰	30	60	210	127	252	27	46	46	19	46
329	600386	北巴传媒	16	156	154	201	391	17	35	47	22	37
330	600387	海越股份	10	302	78	209	446	12	28	48	21	38
331	600388	龙净环保	5	869	34	306	625	6	23	56	22	47
332	600389	江山股份	11	232	104	137	272	11	28	57	21	51
333	600390	金瑞科技	15	173	130	161	330	15	33	54	24	43
334	600391	成发科技	12	189	123	157	324	12	30	54	22	44
335	600392	盛和资源	12	207	112	139	278	12	29	58	25	50
336	600393	东华实业	25	87	193	124	244	23	38	42	17	37

序号	证券代码	证券名称	价格冲击 指数(基点)	流动性指 数(万元)	大宗交易 成本(基点)	五档订单 深度(万元)	十档订单 深度(万元)	相对买卖 价差(基点)	相对有效价 差(基点)	日内波动 率(基点)	超额波动 率(基点)	收益波动 率(基点)
337	600395	盘江股份	9	366	75	298	605	11	24	41	19	32
338	600396	金山股份	16	127	160	176	342	18	31	37	17	28
339	600397	安源煤业	15	164	142	259	507	19	34	46	22	35
340	600398	凯诺科技	17	241	104	508	874	25	40	44	22	34
341	600399	抚顺特钢	16	157	151	248	505	20	42	56	27	44
342	600400	红豆股份	21	124	162	256	474	26	44	45	21	36
343	600401	海润光伏	13	195	118	263	543	17	37	59	28	45
344	600403	大有能源	14	179	131	165	331	15	31	53	23	43
345	600405	动力源	16	154	146	172	358	16	37	50	21	41
346	600406	国电南瑞	8	680	42	413	888	10	26	53	25	40
347	600408	安泰集团	20	188	127	487	834	31	48	45	24	32
348	600409	三友化工	16	271	94	549	1071	24	42	47	24	34
349	600410	华胜天成	12	226	105	290	594	16	33	48	23	35
350	600415	小商品城	11	487	55	709	1384	17	31	45	24	31
351	600416	湘电股份	18	141	156	221	448	20	40	51	24	40
352	600418	江淮汽车	10	414	65	469	985	14	37	57	27	42
353	600419	天润乳业	20	105	199	94	185	17	34	57	22	51
354	600420	现代制药	14	185	129	148	298	15	30	41	18	33
355	600421	*ST 国药	24	87	169	146	294	24	40	39	16	37
356	600422	昆明制药	13	240	106	159	318	13	26	45	20	36
357	600423	柳化股份	19	112	176	208	370	23	39	37	17	29
358	600425	青松建化	15	218	114	346	662	21	39	48	24	36
359	600426	华鲁恒升	11	314	76	418	833	16	32	44	22	30
360	600428	中远航运	19	179	129	445	816	29	48	50	26	36

序号	证券代码	证券名称	价格冲击 指数(基点)	流动性指 数(万元)	大宗交易 成本(基点)	五档订单 深度(万元)	十档订单 深度(万元)	相对买卖 价差(基点)	相对有效价 差(基点)	日内波动 率(基点)	超额波动 率(基点)	收益波动 率(基点)
361	600429	三元股份	15	229	122	313	614	18	39	56	26	42
362	600432	吉恩镍业	15	146	155	143	283	14	25	40	19	30
363	600433	冠豪高新	9	570	52	379	796	11	32	70	29	61
364	600435	北方导航	7	557	49	387	826	9	29	60	27	47
365	600436	片仔癀	8	446	54	151	302	9	17	31	12	26
366	600438	通威股份	17	164	142	239	471	19	36	44	21	34
367	600439	瑞贝卡	17	200	120	427	796	25	43	46	23	33
368	600444	*ST国通	43	49	268	66	131	45	52	30	9	38
369	600446	金证股份	14	181	131	156	314	14	34	63	27	51
370	600448	华纺股份	24	88	178	215	376	29	43	38	18	30
371	600449	宁夏建材	14	178	134	214	423	15	31	44	20	34
372	600452	涪陵电力	22	81	157	99	194	19	28	26	10	23
373	600455	博通股份	22	76	191	74	149	19	28	36	14	33
374	600456	宝钛股份	11	187	129	138	276	11	23	40	17	31
375	600458	时代新材	10	319	76	262	552	11	28	44	20	34
376	600459	贵研铂业	10	189	120	118	237	10	24	45	18	37
377	600460	士兰微	14	246	102	403	812	19	40	55	26	42
378	600461	洪城水业	14	161	136	198	389	15	29	38	17	30
379	600462	石岷纸业	24	95	194	172	335	25	43	46	19	41
380	600463	空港股份	24	74	206	102	202	22	39	48	20	41
381	600466	迪康药业	14	237	112	400	788	20	40	47	23	36
382	600467	好当家	12	247	97	357	692	17	34	43	22	31
383	600468	百利电气	19	136	150	129	275	20	34	45	19	37
384	600469	风神股份	13	172	129	194	378	14	27	37	17	28

序号	证券代码	证券名称	价格冲击 指数(基点)	流动性指 数(万元)	大宗交易 成本(基点)	五档订单 深度(万元)	十档订单 深度(万元)	相对买卖 价差(基点)	相对有效价 差(基点)	日内波动 率(基点)	超额波动 率(基点)	收益波动 率(基点)
385	600470	六国化工	10	344	78	415	845	15	32	43	20	32
386	600475	华光股份	14	141	154	126	261	14	29	49	21	38
387	600476	湘邮科技	27	63	223	83	166	23	38	45	18	39
388	600477	杭萧钢构	25	83	196	189	343	28	44	41	19	33
389	600478	科力远	10	299	82	169	353	11	25	43	17	38
390	600479	千金药业	13	184	123	156	320	14	29	43	19	32
391	600480	凌云股份	16	138	154	188	368	17	33	38	17	30
392	600481	双良节能	11	268	90	275	583	14	32	51	23	38
393	600482	风帆股份	12	200	115	207	427	13	29	47	21	36
394	600483	福建南纺	18	137	142	208	403	20	36	37	17	30
395	600485	中创信测	20	115	157	110	221	17	33	47	20	40
396	600486	扬农化工	10	249	97	135	265	10	22	45	18	39
397	600487	亨通光电	9	232	100	134	271	10	21	37	15	31
398	600488	天药股份	17	174	136	322	611	22	40	45	22	33
399	600489	中金黄金	6	1076	30	836	1739	10	20	33	17	23
400	600490	鹏欣资源	12	284	90	221	459	13	28	44	18	38
401	600491	龙元建设	16	208	113	437	771	24	39	41	21	30
402	600493	凤竹纺织	22	96	169	197	377	26	42	41	19	33
403	600495	晋西车轴	9	292	83	211	433	10	27	45	20	37
404	600496	精工钢构	15	185	126	236	477	17	35	42	19	34
405	600497	驰宏锌锗	9	364	70	293	623	11	26	44	21	33
406	600498	烽火通信	7	628	46	338	703	8	23	48	20	39
407	600499	科达机电	10	370	69	256	544	12	34	56	24	45
408	600500	中化国际	14	218	110	328	646	18	35	45	22	31

序号	证券代码	证券名称	价格冲击 指数(基点)	流动性指 数(万元)	大宗交易 成本(基点)	五档订单 深度(万元)	十档订单 深度(万元)	相对买卖 价差(基点)	相对有效价 差(基点)	日内波动 率(基点)	超额波动 率(基点)	收益波动 率(基点)
409	600501	航天晨光	13	158	142	176	352	15	30	44	20	34
410	600502	安徽水利	9	379	67	365	759	12	27	42	20	31
411	600503	华丽家族	11	726	45	1199	2464	20	40	60	31	43
412	600505	西昌电力	20	117	155	140	279	20	34	33	12	30
413	600506	香梨股份	19	107	181	109	224	17	32	43	17	37
414	600507	方大特钢	19	170	138	373	699	26	45	52	26	39
415	600508	上海能源	12	189	126	161	321	12	23	34	16	28
416	600509	天富热电	11	246	96	259	537	14	29	40	18	31
417	600510	黑牡丹	17	131	148	196	385	19	37	45	21	35
418	600511	国药股份	14	208	111	166	326	15	29	42	19	33
419	600512	腾达建设	20	216	116	576	893	34	47	40	21	29
420	600513	联环药业	14	137	154	129	258	13	28	42	18	36
421	600515	海岛建设	12	248	107	274	587	15	37	62	29	48
422	600516	方大炭素	9	507	53	498	1065	12	27	43	21	32
423	600517	置信电气	11	286	85	228	470	13	27	40	18	31
424	600518	康美药业	6	1178	27	593	1287	8	23	45	21	33
425	600519	贵州茅台	3	2285	14	404	804	4	12	27	11	23
426	600520	中发科技	20	107	179	118	240	19	32	34	13	30
427	600521	华海药业	9	378	62	265	558	11	27	50	23	38
428	600522	中天科技	8	481	53	430	926	11	27	46	22	33
429	600523	贵航股份	15	141	155	124	254	14	31	52	23	42
430	600525	长园集团	14	313	100	442	850	18	39	50	24	38
431	600526	菲达环保	10	228	103	146	292	10	25	48	19	42
432	600527	江南高纤	17	194	123	314	653	21	44	60	29	43

序号	证券代码	证券名称	价格冲击 指数(基点)	流动性指 数(万元)	大宗交易 成本(基点)	五档订单 深度(万元)	十档订单 深度(万元)	相对买卖 价差(基点)	相对有效价 差(基点)	日内波动 率(基点)	超额波动 率(基点)	收益波动 率(基点)
433	600528	中铁二局	12	335	78	506	968	18	33	41	22	28
434	600529	山东药玻	14	159	133	164	329	14	27	34	16	26
435	600530	交大昂立	16	120	159	144	287	16	30	39	17	31
436	600531	豫光金铅	13	134	171	116	227	12	24	34	14	28
437	600532	宏达矿业	18	113	183	118	232	16	31	43	18	36
438	600533	栖霞建设	19	179	115	431	732	29	40	38	19	27
439	600535	天士力	6	717	40	243	497	7	18	40	18	31
440	600536	中国软件	16	166	145	115	230	16	37	63	24	56
441	600537	亿晶光电	11	210	110	195	403	13	30	57	25	46
442	600538	*ST 国发	25	84	178	172	330	27	44	39	16	35
443	600539	ST 狮头	27	64	203	111	215	26	37	28	11	28
444	600540	新赛股份	20	99	199	154	300	20	38	44	20	37
445	600543	莫高股份	12	209	114	229	467	14	29	43	20	32
446	600545	新疆城建	14	212	120	311	627	18	38	47	22	37
447	600546	山煤国际	10	416	63	487	937	13	26	45	22	33
448	600547	山东黄金	4	1443	21	541	1122	5	13	28	13	21
449	600548	深高速	28	87	191	234	390	34	48	32	14	29
450	600549	厦门钨业	6	586	44	234	467	6	19	40	17	32
451	600550	天威保变	13	266	107	388	740	17	34	47	24	34
452	600551	时代出版	12	204	105	172	353	13	28	50	23	38
453	600552	方兴科技	17	157	134	116	239	19	31	38	14	34
454	600555	*ST 九龙	26	108	155	330	564	36	53	42	19	35
455	600556	*ST 北生	25	81	184	202	377	29	44	44	20	37
456	600557	康缘药业	11	348	73	203	414	12	26	46	21	36

序号	证券代码	证券名称	价格冲击 指数(基点)	流动性指 数(万元)	大宗交易 成本(基点)	五档订单 深度(万元)	十档订单 深度(万元)	相对买卖 价差(基点)	相对有效价 差(基点)	日内波动 率(基点)	超额波动 率(基点)	收益波动 率(基点)
457	600558	大西洋	25	80	192	101	205	22	35	35	14	31
458	600559	老白干酒	11	220	109	132	259	11	25	46	18	40
459	600560	金自天正	22	80	214	99	195	19	33	39	16	33
460	600561	江西长运	23	103	189	104	221	22	35	29	11	30
461	600562	国睿科技	21	130	168	86	172	23	34	42	17	39
462	600563	法拉电子	12	175	122	119	242	12	25	43	19	34
463	600565	迪马股份	21	161	147	401	674	28	41	39	20	29
464	600566	洪城股份	21	115	160	117	236	20	37	49	20	41
465	600567	山鹰纸业	23	594	55	1918	3028	43	59	59	34	40
466	600568	中珠控股	13	199	115	214	432	14	30	46	20	39
467	600569	安阳钢铁	30	219	106	819	1124	54	65	54	29	38
468	600570	恒生电子	15	246	102	199	412	17	35	57	26	43
469	600571	信雅达	18	123	165	112	227	16	34	53	22	43
470	600572	康恩贝	10	303	81	238	504	12	28	43	20	32
471	600573	惠泉啤酒	23	79	204	123	230	22	32	31	13	27
472	600575	芜湖港	20	171	139	397	743	28	47	54	27	43
473	600576	万好万家	18	110	178	137	272	17	32	42	18	35
474	600577	精达股份	17	226	111	463	848	24	41	40	20	30
475	600578	京能电力	14	275	94	405	757	18	32	40	20	28
476	600579	*ST 黄海	31	59	192	99	194	29	42	35	12	36
477	600580	卧龙电气	13	282	87	431	864	18	35	47	24	34
478	600581	八一钢铁	16	183	132	340	603	22	36	39	20	28
479	600582	天地科技	12	238	97	278	555	15	29	45	22	32
480	600583	海油工程	9	808	39	983	2110	15	34	50	26	34

序号	证券代码	证券名称	价格冲击 指数(基点)	流动性指 数(万元)	大宗交易 成本(基点)	五档订单 深度(万元)	十档订单 深度(万元)	相对买卖 价差(基点)	相对有效价 差(基点)	日内波动 率(基点)	超额波动 率(基点)	收益波动 率(基点)
481	600584	长电科技	14	279	93	434	902	19	44	53	25	39
482	600585	海螺水泥	6	1158	27	635	1349	8	22	44	21	32
483	600586	金晶科技	17	290	87	699	1245	28	45	51	28	34
484	600587	新华医疗	17	200	120	142	280	18	29	48	20	40
485	600588	用友软件	10	322	76	278	572	12	30	57	26	43
486	600589	广东榕泰	15	201	116	328	627	20	35	40	20	29
487	600590	泰豪科技	16	134	157	195	378	18	35	43	21	33
488	600592	龙溪股份	17	143	157	177	351	18	35	42	19	34
489	600593	大连圣亚	30	55	227	60	117	24	35	32	11	32
490	600594	益佰制药	14	274	95	178	366	15	28	46	20	38
491	600595	中孚实业	20	134	163	297	543	26	41	43	21	32
492	600596	新安股份	9	379	69	294	614	11	31	58	25	46
493	600597	光明乳业	11	352	81	223	469	12	31	54	24	43
494	600598	北大荒	9	524	50	524	1082	13	33	59	29	43
495	600599	熊猫烟花	17	118	169	125	245	15	28	35	15	30
496	600600	青岛啤酒	11	323	77	185	364	13	24	41	19	31
497	600601	方正科技	21	374	74	1208	2022	39	57	57	32	37
498	600602	仪电电子	21	129	167	280	542	26	48	49	24	38
499	600603	*ST 兴业	26	73	179	138	260	26	39	37	15	35
500	600604	市北高新	20	103	190	119	246	19	37	51	20	45
501	600605	汇通能源	23	81	222	100	201	20	36	41	17	35
502	600606	金丰投资	14	221	111	334	671	18	38	54	26	39
503	600608	上海科技	20	103	185	151	308	20	39	48	20	41
504	600609	金杯汽车	19	216	116	566	1012	30	51	52	26	39

序号	证券代码	证券名称	价格冲击 指数(基点)	流动性指 数(万元)	大宗交易 成本(基点)	五档订单 深度(万元)	十档订单 深度(万元)	相对买卖 价差(基点)	相对有效价 差(基点)	日内波动 率(基点)	超额波动 率(基点)	收益波动 率(基点)
505	600610	S 中纺机	37	50	222	56	111	35	45	34	11	39
506	600611	大众交通	14	209	111	326	671	19	39	51	25	38
507	600612	老凤祥	13	172	138	124	245	13	27	41	17	36
508	600613	神奇制药	16	116	162	93	181	13	26	38	14	37
509	600614	鼎立股份	11	395	62	332	679	14	26	43	23	30
510	600615	丰华股份	22	106	168	113	232	20	34	43	18	38
511	600616	金枫酒业	13	188	122	212	426	14	30	43	20	31
512	600617	*ST 联华	27	127	124	114	249	31	39	26	9	29
513	600618	氯碱化工	18	115	163	145	292	18	34	41	18	34
514	600619	海立股份	22	102	171	143	271	20	36	42	18	36
515	600620	天宸股份	14	227	113	298	631	18	40	65	30	50
516	600621	华鑫股份	18	122	163	215	407	21	40	47	22	36
517	600622	嘉宝集团	14	186	133	262	514	17	33	42	20	31
518	600623	双钱股份	21	77	200	88	171	17	33	41	16	37
519	600624	复旦复华	12	218	111	238	500	14	36	59	27	46
520	600626	申达股份	18	197	114	399	755	26	46	57	28	44
521	600628	新世界	13	189	118	248	483	16	31	39	18	30
522	600629	棱光实业	28	67	226	88	175	24	40	42	16	40
523	600630	龙头股份	15	168	139	240	488	18	38	53	24	42
524	600633	浙报传媒	11	247	99	152	302	12	31	61	26	50
525	600634	ST 澄海	30	59	207	79	151	27	39	32	10	36
526	600635	大众公用	15	294	86	551	1094	22	43	52	27	37
527	600636	三爱富	10	237	100	186	385	11	28	45	19	37
528	600637	百视通	7	613	45	285	590	9	27	60	26	47

序号	证券代码	证券名称	价格冲击 指数(基点)	流动性指 数(万元)	大宗交易 成本(基点)	五档订单 深度(万元)	十档订单 深度(万元)	相对买卖 价差(基点)	相对有效价 差(基点)	日内波动 率(基点)	超额波动 率(基点)	收益波动 率(基点)
529	600638	新黄浦	14	215	114	196	401	15	31	39	16	33
530	600639	浦东金桥	15	177	132	182	370	15	35	55	24	47
531	600640	号百控股	15	195	127	166	335	15	36	62	28	51
532	600641	万业企业	22	111	177	243	451	27	46	49	23	38
533	600642	申能股份	13	655	45	1318	2326	23	36	41	23	26
534	600643	爱建股份	11	363	79	339	708	14	33	58	27	43
535	600644	乐山电力	13	214	117	244	494	15	31	38	17	30
536	600645	中源协和	10	362	71	197	407	11	28	51	20	43
537	600647	同达创业	24	72	222	78	156	22	36	42	16	38
538	600648	外高桥	11	353	103	188	379	11	31	58	24	49
539	600649	城投控股	11	473	58	594	1265	16	38	54	27	38
540	600650	锦江投资	20	104	160	123	235	18	35	42	17	38
541	600651	飞乐音响	15	211	111	340	683	19	40	53	26	39
542	600652	爱使股份	17	191	128	393	732	24	45	48	24	36
543	600653	申华控股	24	198	120	671	1110	41	59	51	28	36
544	600654	飞乐股份	14	229	105	310	631	18	38	47	22	37
545	600655	豫园商城	11	354	73	419	854	15	30	43	22	30
546	600656	博元投资	20	118	169	167	333	20	37	47	20	40
547	600657	信达地产	21	148	147	342	613	29	47	47	23	34
548	600658	电子城	14	156	131	159	323	14	31	50	22	40
549	600660	福耀玻璃	11	424	63	468	973	14	28	40	21	26
550	600661	新南洋	19	132	154	141	283	18	38	55	25	47
551	600662	强生控股	20	135	157	298	544	26	44	45	22	33
552	600663	陆家嘴	12	222	113	162	330	12	28	46	20	39

序号	证券代码	证券名称	价格冲击 指数(基点)	流动性指 数(万元)	大宗交易 成本(基点)	五档订单 深度(万元)	十档订单 深度(万元)	相对买卖 价差(基点)	相对有效价 差(基点)	日内波动 率(基点)	超额波动 率(基点)	收益波动 率(基点)
553	600664	哈药股份	11	445	58	624	1244	16	29	41	22	27
554	600665	天地源	22	114	164	279	482	29	45	41	20	31
555	600666	西南药业	16	128	165	170	335	17	31	38	17	29
556	600667	太极实业	18	319	87	847	1535	31	53	53	28	37
557	600668	尖峰集团	9	342	73	324	670	12	27	43	20	32
558	600671	天目药业	28	83	200	94	194	28	42	37	12	38
559	600673	东阳光铝	14	195	123	255	493	17	34	43	20	34
560	600674	川投能源	9	473	52	426	897	12	23	39	19	27
561	600675	中华企业	12	415	66	623	1322	18	43	61	30	45
562	600676	交运股份	18	145	137	265	512	23	41	44	21	35
563	600677	航天通信	12	224	114	220	460	13	33	53	25	41
564	600678	四川金顶	16	164	144	229	454	18	37	54	24	46
565	600679	金山开发	19	100	177	108	213	17	36	55	22	50
566	600680	上海普天	23	73	207	87	165	18	34	41	16	37
567	600681	万鸿集团	27	71	225	145	276	27	45	45	20	38
568	600682	南京新百	22	131	143	144	304	22	33	31	12	29
569	600683	京投银泰	19	123	172	219	428	22	43	55	25	43
570	600684	珠江实业	10	310	81	290	606	13	28	51	24	39
571	600685	广船国际	13	179	125	150	305	12	29	49	21	40
572	600686	金龙汽车	18	121	164	146	290	18	36	48	21	39
573	600687	刚泰控股	15	130	167	113	220	14	25	35	14	30
574	600688	上海石化	14	474	69	991	1735	22	36	44	23	31
575	600689	上海三毛	22	93	180	121	226	19	35	49	20	44
576	600690	青岛海尔	9	542	51	379	814	11	28	49	25	34

序号	证券代码	证券名称	价格冲击 指数(基点)	流动性指 数(万元)	大宗交易 成本(基点)	五档订单 深度(万元)	十档订单 深度(万元)	相对买卖 价差(基点)	相对有效价 差(基点)	日内波动 率(基点)	超额波动 率(基点)	收益波动 率(基点)
577	600691	阳煤化工	18	225	119	249	508	21	35	43	17	41
578	600692	亚通股份	13	206	117	244	504	15	37	58	27	46
579	600693	东百集团	21	114	166	159	312	21	34	31	12	28
580	600694	大商股份	7	408	57	192	388	7	17	39	17	32
581	600695	大江股份	26	82	187	156	299	26	44	45	20	39
582	600696	多伦股份	14	275	102	403	821	19	35	50	24	37
583	600697	欧亚集团	20	119	165	111	213	21	29	30	12	29
584	600698	ST 轻骑	20	113	144	294	482	28	39	35	16	28
585	600699	均胜电子	15	184	125	154	317	15	33	53	23	44
586	600701	工大高新	19	146	157	297	577	24	46	53	26	40
587	600702	沱牌舍得	8	385	64	227	462	9	24	46	20	38
588	600703	三安光电	9	481	57	297	620	10	29	57	26	45
589	600704	物产中大	13	237	106	294	598	17	37	50	23	38
590	600705	中航投资	7	579	42	340	719	8	26	53	23	42
591	600706	曲江文旅	23	78	186	78	158	19	31	41	16	37
592	600707	*ST 彩虹	17	157	132	266	551	21	44	48	21	40
593	600708	海博股份	18	142	152	211	426	20	41	51	23	41
594	600710	常林股份	21	143	165	327	574	29	44	43	22	32
595	600711	盛屯矿业	20	96	179	109	215	18	31	42	17	37
596	600712	南宁百货	21	129	185	258	492	26	42	38	17	32
597	600713	南京医药	16	209	111	390	764	22	42	47	24	34
598	600714	金瑞矿业	20	85	204	97	188	17	31	39	16	34
599	600715	松辽汽车	22	99	184	162	311	23	36	34	14	30
600	600716	凤凰股份	22	110	180	191	407	24	45	43	19	36

序号	证券代码	证券名称	价格冲击 指数(基点)	流动性指 数(万元)	大宗交易 成本(基点)	五档订单 深度(万元)	十档订单 深度(万元)	相对买卖 价差(基点)	相对有效价 差(基点)	日内波动 率(基点)	超额波动 率(基点)	收益波动 率(基点)
601	600717	天津港	11	330	82	446	853	17	32	43	21	33
602	600718	东软集团	12	303	85	272	578	13	32	58	28	42
603	600719	大连热电	20	124	177	175	327	19	34	38	17	32
604	600720	祁连山	9	440	60	476	972	13	30	48	23	35
605	600721	百花村	24	81	177	102	196	20	33	38	15	34
606	600722	金牛化工	21	140	172	252	479	23	40	45	20	37
607	600723	首商股份	13	190	126	265	495	16	31	34	16	25
608	600724	宁波富达	19	130	159	237	432	22	36	42	20	33
609	600725	云维股份	25	87	198	205	372	29	45	46	22	36
610	600726	华电能源	26	124	154	428	670	40	54	44	22	34
611	600727	鲁北化工	22	90	179	179	342	25	41	39	17	33
612	600728	佳都科技	13	242	103	186	396	14	37	56	24	46
613	600729	重庆百货	11	194	118	134	263	11	21	40	16	34
614	600730	中国高科	18	117	188	142	286	18	35	46	20	38
615	600731	湖南海利	21	102	179	142	288	21	39	42	18	34
616	600732	上海新梅	15	256	106	439	880	21	43	63	31	48
617	600733	S 前锋	22	80	185	69	138	21	33	38	15	35
618	600734	实达集团	26	81	224	175	336	28	46	47	22	38
619	600735	新华锦	16	121	179	148	288	16	34	51	23	41
620	600736	苏州高新	17	229	107	500	929	26	43	46	24	32
621	600737	中粮屯河	17	166	138	267	531	21	39	48	24	35
622	600738	兰州民百	16	168	148	255	486	19	35	38	18	29
623	600739	辽宁成大	6	885	32	506	1095	8	25	47	22	33
624	600740	山西焦化	12	236	110	295	592	15	34	46	21	35

序号	证券代码	证券名称	价格冲击 指数(基点)	流动性指 数(万元)	大宗交易 成本(基点)	五档订单 深度(万元)	十档订单 深度(万元)	相对买卖 价差(基点)	相对有效价 差(基点)	日内波动 率(基点)	超额波动 率(基点)	收益波动 率(基点)
625	600741	华域汽车	9	623	46	623	1246	12	25	38	20	25
626	600742	一汽富维	10	234	97	157	320	11	22	39	17	30
627	600743	华远地产	24	139	143	407	684	35	49	43	22	32
628	600744	华银电力	20	180	135	437	757	29	48	47	24	36
629	600745	中茵股份	19	137	163	128	268	20	38	54	22	47
630	600746	江苏索普	23	83	229	140	274	23	42	50	21	42
631	600747	大连控股	17	261	101	547	1034	25	41	46	24	32
632	600748	上实发展	13	235	105	277	573	16	36	58	27	45
633	600749	西藏旅游	16	134	162	150	304	15	28	35	16	28
634	600750	江中药业	10	311	79	199	409	11	22	37	16	28
635	600751	天津海运	16	202	123	340	708	21	51	90	43	72
636	600753	东方银星	24	94	201	116	224	23	39	46	17	43
637	600754	锦江股份	14	139	145	120	232	13	25	35	14	31
638	600755	厦门国贸	15	294	85	570	1064	23	41	46	24	33
639	600756	浪潮软件	11	242	99	209	435	12	32	59	26	48
640	600757	长江传媒	15	188	123	238	486	17	35	51	24	38
641	600758	红阳能源	22	79	205	106	206	20	33	37	15	31
642	600759	正和股份	15	371	89	690	1327	22	44	52	26	39
643	600760	*ST 黑豹	22	110	158	189	369	23	40	41	18	35
644	600761	安徽合力	14	180	120	191	383	15	28	42	20	31
645	600763	通策医疗	13	186	119	119	239	14	27	43	17	36
646	600764	中电广通	21	125	156	159	336	21	42	45	20	38
647	600765	中航重机	7	587	46	370	789	9	29	59	27	45
648	600766	园城黄金	24	119	162	133	273	25	38	39	15	37

序号	证券代码	证券名称	价格冲击 指数(基点)	流动性指 数(万元)	大宗交易 成本(基点)	五档订单 深度(万元)	十档订单 深度(万元)	相对买卖 价差(基点)	相对有效价 差(基点)	日内波动 率(基点)	超额波动 率(基点)	收益波动 率(基点)
649	600767	运盛实业	22	110	176	202	411	24	46	52	23	41
650	600768	宁波富邦	27	65	217	97	187	23	37	36	14	32
651	600769	*ST 祥龙	25	77	194	173	336	28	46	41	17	38
652	600770	综艺股份	12	342	74	429	925	16	38	60	29	43
653	600771	广誉远	14	224	103	156	325	16	33	50	19	46
654	600773	西藏城投	12	210	110	187	379	13	26	43	19	34
655	600774	汉商集团	26	67	224	77	150	22	35	35	12	34
656	600775	南京熊猫	23	101	186	133	257	20	39	47	20	41
657	600776	东方通信	18	140	158	248	490	21	43	50	24	39
658	600777	新潮实业	18	162	141	283	569	23	44	45	21	36
659	600778	友好集团	11	217	108	225	438	13	25	34	16	27
660	600779	水井坊	10	263	98	196	390	10	22	42	20	31
661	600780	通宝能源	16	182	137	268	513	19	36	47	23	36
662	600781	上海辅仁	20	121	142	108	217	21	32	33	12	31
663	600782	新钢股份	25	97	198	220	372	30	47	39	17	33
664	600783	鲁信创投	11	245	100	165	340	11	29	59	26	46
665	600784	鲁银投资	15	217	120	327	670	19	37	51	24	39
666	600785	新华百货	12	161	138	138	272	12	23	34	15	27
667	600787	中储股份	11	308	82	334	698	14	35	57	26	42
668	600789	鲁抗医药	15	247	106	461	870	22	40	48	24	36
669	600790	轻纺城	14	222	105	329	637	18	32	38	19	28
670	600791	京能置业	25	89	196	169	338	27	47	47	20	39
671	600792	云煤能源	23	76	209	85	169	19	33	41	16	38
672	600793	ST 宜纸	42	43	208	60	117	43	50	26	7	33

序号	证券代码	证券名称	价格冲击 指数(基点)	流动性指 数(万元)	大宗交易 成本(基点)	五档订单 深度(万元)	十档订单 深度(万元)	相对买卖 价差(基点)	相对有效价 差(基点)	日内波动 率(基点)	超额波动 率(基点)	收益波动 率(基点)
673	600794	保税科技	15	161	144	181	365	16	33	50	22	42
674	600795	国电电力	20	2052	28	6360	9321	40	54	55	32	33
675	600796	钱江生化	18	144	144	234	449	20	37	39	18	31
676	600797	浙大网新	13	325	83	522	1075	20	42	57	28	41
677	600798	宁波海运	23	114	171	290	522	30	48	41	20	34
678	600800	天津磁卡	12	373	77	539	1082	17	37	55	26	45
679	600801	华新水泥	9	313	78	245	492	11	27	47	21	38
680	600802	福建水泥	13	287	97	392	764	17	34	46	22	36
681	600803	威远生化	13	169	127	159	329	14	30	45	19	38
682	600804	鹏博士	7	1084	34	755	1638	11	35	67	32	48
683	600805	悦达投资	8	514	52	398	853	10	27	48	22	36
684	600806	昆明机床	21	94	196	168	321	22	41	49	22	40
685	600807	天业股份	19	115	182	154	302	19	34	42	18	35
686	600808	马钢股份	29	461	61	1763	2308	55	64	61	35	39
687	600809	山西汾酒	7	487	51	247	493	7	21	43	19	35
688	600810	神马股份	18	126	172	204	392	21	37	45	20	36
689	600811	东方集团	12	363	71	558	1113	18	37	51	26	34
690	600812	华北制药	15	251	104	401	791	20	38	45	23	32
691	600814	杭州解百	20	117	153	169	327	20	33	34	14	30
692	600815	厦工股份	14	267	101	471	856	21	36	41	21	30
693	600816	安信信托	9	296	83	210	433	10	26	52	23	40
694	600817	ST宏盛	25	104	170	122	257	26	38	49	19	39
695	600818	中路股份	18	130	140	107	224	17	31	38	15	35
696	600819	耀皮玻璃	29	57	230	92	180	24	41	38	15	36

序号	证券代码	证券名称	价格冲击 指数(基点)	流动性指 数(万元)	大宗交易 成本(基点)	五档订单 深度(万元)	十档订单 深度(万元)	相对买卖 价差(基点)	相对有效价 差(基点)	日内波动 率(基点)	超额波动 率(基点)	收益波动 率(基点)
697	600820	隧道股份	10	306	79	324	652	13	25	33	16	24
698	600821	津劝业	22	109	179	211	395	24	44	44	20	38
699	600822	上海物贸	18	161	139	203	410	20	41	58	26	50
700	600823	世茂股份	10	272	86	273	542	13	25	39	18	29
701	600824	益民集团	18	152	136	292	562	23	43	45	21	34
702	600825	新华传媒	14	268	98	387	782	18	41	59	28	44
703	600826	兰生股份	14	187	123	147	309	14	32	49	21	40
704	600827	友谊股份	11	348	75	397	780	14	29	49	25	35
705	600828	成商集团	23	90	195	171	325	24	40	42	19	34
706	600829	三精制药	17	120	157	151	287	17	29	35	16	29
707	600830	香溢融通	11	299	94	320	670	14	34	61	29	47
708	600831	广电网络	11	297	85	345	720	14	31	49	23	35
709	600832	东方明珠	11	653	54	935	1784	17	39	55	28	39
710	600833	第一医药	14	157	135	183	367	15	31	41	18	32
711	600834	申通地铁	19	91	187	130	249	19	31	32	14	27
712	600835	上海机电	13	228	103	217	440	14	31	48	22	38
713	600836	界龙实业	15	138	145	167	345	15	32	42	19	35
714	600837	海通证券	6	2714	16	2036	4557	10	32	54	27	36
715	600838	上海九百	16	209	141	325	634	20	41	52	25	40
716	600839	四川长虹	23	1449	35	4594	6873	45	63	67	39	42
717	600841	上柴股份	22	93	192	87	178	20	34	42	17	38
718	600843	上工申贝	25	76	247	104	209	21	40	45	18	40
719	600844	丹化科技	12	229	109	233	481	14	31	46	21	36
720	600845	宝信软件	20	96	198	81	163	18	32	43	16	40

序号	证券代码	证券名称	价格冲击 指数(基点)	流动性指 数(万元)	大宗交易 成本(基点)	五档订单 深度(万元)	十档订单 深度(万元)	相对买卖 价差(基点)	相对有效价 差(基点)	日内波动 率(基点)	超额波动 率(基点)	收益波动 率(基点)
721	600846	同济科技	14	255	102	417	839	20	41	53	26	38
722	600847	万里股份	37	50	233	53	107	34	44	33	11	38
723	600848	自仪股份	25	74	208	110	214	21	40	43	18	37
724	600850	华东电脑	15	165	135	115	234	16	28	41	16	36
725	600851	海欣股份	11	291	85	364	768	15	35	53	25	40
726	600853	龙建股份	27	88	183	259	422	37	50	36	17	29
727	600854	春兰股份	21	116	181	233	431	25	45	47	23	36
728	600855	航天长峰	14	205	132	193	400	14	36	56	25	44
729	600856	长百集团	29	71	220	128	248	28	47	45	19	39
730	600857	工大首创	24	71	229	90	174	21	36	37	14	35
731	600858	银座股份	13	200	113	239	462	15	29	41	19	31
732	600859	王府井	9	278	82	181	363	10	20	38	18	29
733	600860	北人股份	22	102	189	127	260	21	40	53	22	45
734	600861	北京城乡	18	122	149	175	336	20	31	29	12	24
735	600862	南通科技	20	201	130	488	824	30	45	43	22	31
736	600863	内蒙华电	14	473	58	977	1738	23	37	47	26	31
737	600864	哈投股份	12	222	106	223	472	14	34	56	25	44
738	600865	百大集团	16	205	120	324	660	21	37	38	18	29
739	600866	星湖科技	20	128	161	262	497	25	43	46	23	35
740	600867	通化东宝	9	361	68	253	529	11	29	47	21	37
741	600868	梅雁吉祥	22	481	63	1562	2520	41	58	59	33	40
742	600869	远东电缆	16	160	143	199	383	16	33	45	20	38
743	600870	厦华电子	22	105	185	225	426	26	44	52	24	43
744	600871	仪征化纤	19	137	129	298	527	23	37	39	19	31

序号	证券代码	证券名称	价格冲击 指数(基点)	流动性指 数(万元)	大宗交易 成本(基点)	五档订单 深度(万元)	十档订单 深度(万元)	相对买卖 价差(基点)	相对有效价 差(基点)	日内波动 率(基点)	超额波动 率(基点)	收益波动 率(基点)
745	600872	中炬高新	13	272	92	313	680	16	44	55	26	40
746	600873	梅花集团	17	194	127	338	682	22	39	55	28	40
747	600874	创业环保	10	427	64	473	980	13	32	51	22	42
748	600875	东方电气	8	466	54	352	735	10	23	38	18	28
749	600876	洛阳玻璃	32	53	233	95	180	27	43	37	14	35
750	600877	中国嘉陵	22	149	147	375	712	30	49	53	26	42
751	600879	航天电子	9	487	59	519	1093	13	34	54	26	40
752	600880	博瑞传播	8	615	45	376	796	10	32	67	31	49
753	600881	亚泰集团	14	405	64	806	1501	23	37	45	25	29
754	600882	华联矿业	17	120	170	128	248	16	30	42	18	34
755	600883	博闻科技	27	65	219	102	196	23	38	37	15	33
756	600884	杉杉股份	11	238	100	188	394	12	29	49	21	38
757	600885	宏发股份	17	153	143	136	280	17	32	46	19	39
758	600886	国投电力	13	920	36	1947	3436	23	37	46	26	29
759	600887	伊利股份	6	917	34	361	746	8	21	51	23	39
760	600888	新疆众和	15	160	146	211	432	17	31	41	19	31
761	600889	南京化纤	20	131	183	226	437	23	44	48	23	37
762	600890	中房股份	19	141	157	187	402	20	38	52	23	44
763	600891	秋林集团	18	116	182	162	309	19	33	38	17	32
764	600892	宝诚股份	44	44	304	51	104	43	50	30	10	37
765	600893	航空动力	7	523	48	301	639	9	26	54	24	41
766	600894	广日股份	18	167	130	185	394	19	36	47	20	38
767	600895	张江高科	12	311	80	414	835	16	33	48	24	35
768	600896	中海海盛	24	104	167	265	500	30	50	46	22	37

序号	证券代码	证券名称	价格冲击 指数(基点)	流动性指 数(万元)	大宗交易 成本(基点)	五档订单 深度(万元)	十档订单 深度(万元)	相对买卖 价差(基点)	相对有效价 差(基点)	日内波动 率(基点)	超额波动 率(基点)	收益波动 率(基点)
769	600897	厦门空港	17	108	181	94	187	16	25	30	12	26
770	600898	三联商社	24	87	198	161	309	25	41	43	19	36
771	600900	长江电力	10	1000	31	1344	2571	16	27	36	21	21
772	600960	渤海活塞	20	95	170	122	226	17	32	34	13	31
773	600961	*ST株冶	20	121	147	179	338	20	33	34	14	30
774	600962	国投中鲁	25	76	188	110	209	22	34	35	15	30
775	600963	岳阳林纸	19	188	123	487	820	30	46	47	25	33
776	600965	福成五丰	17	134	158	203	389	19	36	44	21	33
777	600966	博汇纸业	17	138	136	270	477	23	34	29	13	23
778	600967	北方创业	12	231	104	165	337	13	28	48	20	41
779	600969	郴电国际	24	111	164	112	229	24	42	46	20	39
780	600970	中材国际	9	382	66	356	736	12	24	42	20	31
781	600971	恒源煤电	11	219	111	220	437	13	28	44	21	33
782	600973	宝胜股份	16	129	153	163	331	16	31	41	18	33
783	600975	新五丰	17	139	153	206	397	18	35	39	18	31
784	600976	武汉健民	12	224	102	146	300	12	26	45	19	36
785	600978	宜华木业	14	300	84	516	1018	21	39	47	24	32
786	600979	广安爱众	17	150	146	251	503	21	42	51	23	41
787	600980	*ST北磁	20	81	180	84	166	17	29	35	13	33
788	600981	汇鸿股份	27	71	237	167	305	30	47	39	17	34
789	600982	宁波热电	23	79	200	87	170	20	32	35	13	33
790	600983	合肥三洋	16	153	141	159	320	16	33	46	20	37
791	600984	建设机械	32	56	230	88	166	26	39	37	15	34
792	600985	雷鸣科化	23	82	179	81	165	18	32	33	13	31

序号	证券代码	证券名称	价格冲击 指数(基点)	流动性指 数(万元)	大宗交易 成本(基点)	五档订单 深度(万元)	十档订单 深度(万元)	相对买卖 价差(基点)	相对有效价 差(基点)	日内波动 率(基点)	超额波动 率(基点)	收益波动 率(基点)
793	600986	科达股份	20	109	187	206	381	23	39	37	17	30
794	600987	航民股份	15	174	132	221	449	17	35	49	22	38
795	600988	赤峰黄金	12	169	137	126	252	12	23	43	19	36
796	600990	四创电子	16	171	135	125	247	16	33	52	20	47
797	600992	贵绳股份	30	56	200	85	163	25	35	26	10	26
798	600993	马应龙	10	243	93	159	326	10	24	41	18	32
799	600995	文山电力	14	221	109	374	685	20	32	35	18	25
800	600997	开滦股份	13	248	108	335	644	17	29	40	20	28
801	600998	九州通	16	159	123	146	291	17	28	35	15	29
802	600999	招商证券	7	785	38	587	1265	10	30	54	27	37
803	601000	唐山港	23	170	132	441	726	33	48	47	25	34
804	601001	大同煤业	14	199	124	247	495	16	32	43	21	33
805	601002	晋亿实业	10	273	88	267	551	12	28	43	20	34
806	601003	柳钢股份	30	113	182	344	540	42	57	43	20	35
807	601005	重庆钢铁	23	154	147	477	825	36	57	56	29	42
808	601006	大秦铁路	10	1164	31	1531	3021	16	29	44	24	27
809	601007	金陵饭店	19	95	175	123	232	18	30	29	13	25
810	601008	连云港	20	169	133	433	715	31	45	43	22	32
811	601009	南京银行	8	851	36	858	1822	12	24	35	18	23
812	601010	文峰股份	15	141	150	167	329	16	28	35	15	28
813	601011	宝泰隆	18	122	175	125	254	16	29	38	16	33
814	601012	隆基股份	16	167	135	172	349	17	40	63	28	51
815	601018	宁波港	22	1032	42	3071	4157	43	52	52	31	33
816	601028	玉龙股份	16	131	159	140	283	16	32	45	19	38

序号	证券代码	证券名称	价格冲击 指数(基点)	流动性指 数(万元)	大宗交易 成本(基点)	五档订单 深度(万元)	十档订单 深度(万元)	相对买卖 价差(基点)	相对有效价 差(基点)	日内波动 率(基点)	超额波动 率(基点)	收益波动 率(基点)
817	601038	一拖股份	11	241	104	241	504	13	32	54	24	43
818	601058	赛轮股份	17	155	137	154	324	17	30	41	17	34
819	601088	中国神华	5	1442	21	728	1555	7	15	29	15	19
820	601098	中南传媒	10	311	76	278	578	12	29	48	23	35
821	601099	太平洋	11	565	51	927	1846	19	32	49	26	33
822	601100	恒立油缸	18	116	175	121	240	17	30	44	20	35
823	601101	昊华能源	10	269	90	254	522	12	25	44	21	32
824	601106	中国一重	23	546	55	1757	2548	43	54	54	32	34
825	601107	四川成渝	22	166	142	459	705	34	46	39	20	29
826	601111	中国国航	14	528	55	1041	1828	23	37	44	25	27
827	601113	华鼎股份	25	85	192	188	334	28	45	40	17	34
828	601116	三江购物	20	87	199	95	185	17	28	29	11	27
829	601117	中国化学	8	960	33	1005	2114	13	31	51	26	34
830	601118	海南橡胶	12	536	58	755	1582	18	43	68	35	48
831	601126	四方股份	17	135	155	113	227	17	29	41	18	33
832	601137	博威合金	22	78	202	69	140	18	28	29	11	28
833	601139	深圳燃气	11	300	81	324	657	13	28	39	19	30
834	601158	重庆水务	13	295	86	451	885	18	33	46	24	32
835	601166	兴业银行	5	3371	13	2304	4894	8	25	46	23	32
836	601168	西部矿业	11	413	62	570	1109	16	30	41	22	26
837	601169	北京银行	8	1223	26	1355	2700	13	27	39	22	25
838	601177	杭齿前进	26	74	187	104	182	22	33	30	11	29
839	601179	中国西电	18	342	74	853	1389	30	44	45	25	29
840	601186	中国铁建	12	768	38	1359	2414	20	33	41	24	25

序号	证券代码	证券名称	价格冲击 指数(基点)	流动性指 数(万元)	大宗交易 成本(基点)	五档订单 深度(万元)	十档订单 深度(万元)	相对买卖 价差(基点)	相对有效价 差(基点)	日内波动 率(基点)	超额波动 率(基点)	收益波动 率(基点)
841	601188	龙江交通	30	98	196	325	505	42	56	38	18	32
842	601199	江南水务	13	131	153	105	211	12	24	34	14	29
843	601208	东材科技	17	132	159	185	376	19	33	42	19	33
844	601216	内蒙君正	13	275	102	272	559	15	33	62	29	46
845	601218	吉鑫科技	20	129	174	235	448	24	42	49	23	38
846	601222	林洋电子	13	182	124	141	287	13	29	49	21	41
847	601231	环旭电子	12	213	107	153	308	12	28	55	23	45
848	601233	桐昆股份	16	152	147	217	421	18	32	44	21	32
849	601238	广汽集团	15	172	138	218	434	17	34	56	27	41
850	601258	庞大集团	15	211	111	352	683	20	37	55	28	39
851	601268	*ST 二重	20	138	146	307	532	26	41	38	18	32
852	601288	农业银行	19	5347	23	15125	19440	38	48	50	29	31
853	601299	中国北车	13	1085	33	2111	3996	23	43	50	27	33
854	601311	骆驼股份	10	308	78	262	550	12	31	54	25	40
855	601313	江南嘉捷	15	169	137	186	381	16	33	46	20	36
856	601318	中国平安	3	3681	10	910	1945	4	16	35	16	26
857	601328	交通银行	12	2799	19	5745	9366	23	35	41	24	24
858	601333	广深铁路	20	626	47	1927	3078	36	54	56	33	34
859	601336	新华保险	7	481	48	238	480	8	20	46	21	34
860	601339	百隆东方	14	152	138	168	333	15	27	32	14	25
861	601369	陕鼓动力	13	224	110	266	534	15	26	37	19	25
862	601377	兴业证券	8	564	46	488	1021	11	26	47	23	32
863	601388	怡球资源	13	165	139	148	302	13	29	47	20	37
864	601390	中国中铁	19	1087	34	3340	5097	36	50	50	30	30

序号	证券代码	证券名称	价格冲击 指数(基点)	流动性指 数(万元)	大宗交易 成本(基点)	五档订单 深度(万元)	十档订单 深度(万元)	相对买卖 价差(基点)	相对有效价 差(基点)	日内波动 率(基点)	超额波动 率(基点)	收益波动 率(基点)
865	601398	工商银行	13	4713	18	10343	14410	25	34	36	21	21
866	601515	东风股份	16	139	147	113	227	15	28	42	17	36
867	601518	吉林高速	27	140	143	448	688	43	54	38	19	31
868	601519	大智慧	15	230	113	359	762	20	46	67	32	51
869	601555	东吴证券	8	671	41	732	1585	13	30	50	25	34
870	601558	华锐风电	18	152	149	274	509	23	36	43	22	32
871	601566	九牧王	11	199	117	152	305	11	23	38	17	30
872	601567	三星电气	18	98	166	113	219	16	29	34	14	30
873	601588	北辰实业	21	229	109	658	1078	34	50	47	25	32
874	601599	鹿港科技	20	112	168	142	292	20	36	39	16	36
875	601600	中国铝业	15	523	54	1106	1894	26	40	48	27	31
876	601601	中国太保	6	1113	27	562	1202	8	23	42	22	28
877	601607	上海医药	8	585	46	424	895	10	26	45	22	33
878	601608	中信重工	17	313	84	774	1294	29	44	42	23	28
879	601616	广电电气	19	179	126	426	774	27	43	43	22	31
880	601618	中国中冶	27	1458	36	4971	6498	53	61	62	37	38
881	601628	中国人寿	6	1061	28	610	1314	8	20	35	18	23
882	601633	长城汽车	10	326	79	165	336	11	24	56	25	45
883	601636	旗滨集团	16	152	151	213	415	18	34	42	20	32
884	601666	平煤股份	11	350	72	496	952	17	31	41	22	28
885	601668	中国建筑	15	2781	22	6867	11039	29	45	49	29	28
886	601669	中国水电	16	1425	28	3769	5951	31	44	49	29	29
887	601677	明泰铝业	19	85	188	96	188	16	29	34	14	29
888	601678	滨化股份	14	156	144	181	355	15	28	37	17	29

序号	证券代码	证券名称	价格冲击 指数(基点)	流动性指 数(万元)	大宗交易 成本(基点)	五档订单 深度(万元)	十档订单 深度(万元)	相对买卖 价差(基点)	相对有效价 差(基点)	日内波动 率(基点)	超额波动 率(基点)	收益波动 率(基点)
889	601688	华泰证券	7	895	33	839	1808	12	30	49	25	33
890	601699	潞安环能	7	608	44	398	815	9	24	46	22	34
891	601700	风范股份	14	160	133	144	290	14	29	39	16	35
892	601717	郑煤机	10	461	57	527	1061	14	27	41	21	28
893	601718	际华集团	20	473	62	1386	2107	36	51	47	27	30
894	601727	上海电气	18	212	115	488	855	27	44	42	22	31
895	601766	中国南车	13	1197	31	2393	4487	23	43	48	27	31
896	601777	力帆股份	17	117	158	171	331	18	32	36	16	28
897	601788	光大证券	7	811	38	698	1443	11	26	46	23	32
898	601789	宁波建工	15	155	141	188	380	16	31	43	19	34
899	601798	蓝科高新	17	109	175	99	203	15	29	41	16	34
900	601799	星宇股份	17	108	190	97	198	16	28	40	16	33
901	601800	中国交建	13	685	40	1325	2276	23	33	40	24	24
902	601801	皖新传媒	12	240	105	203	423	13	29	48	21	37
903	601808	中海油服	9	431	61	248	525	10	24	43	21	32
904	601818	光大银行	17	3419	22	9363	13341	34	46	50	29	30
905	601857	中国石油	7	1791	20	2184	3938	13	21	27	15	16
906	601866	中海集运	23	424	65	1503	2462	43	62	63	36	41
907	601872	招商轮船	25	229	108	776	1186	43	60	53	29	38
908	601877	正泰电器	16	189	125	146	286	17	26	36	15	32
909	601880	大连港	22	356	87	1118	1654	39	52	49	27	34
910	601886	江河创建	10	311	81	287	559	11	24	43	19	36
911	601888	中国国旅	8	396	62	213	422	10	19	41	19	31
912	601890	亚星锚链	16	128	163	165	325	17	31	41	18	33

序号	证券代码	证券名称	价格冲击 指数(基点)	流动性指 数(万元)	大宗交易 成本(基点)	五档订单 深度(万元)	十档订单 深度(万元)	相对买卖 价差(基点)	相对有效价 差(基点)	日内波动 率(基点)	超额波动 率(基点)	收益波动 率(基点)
913	601898	中煤能源	12	458	56	691	1296	18	30	38	22	24
914	601899	紫金矿业	18	2005	27	5400	8018	35	47	49	28	30
915	601901	方正证券	9	1858	24	2504	5486	16	43	68	33	47
916	601908	京运通	14	196	129	248	497	16	35	54	25	42
917	601918	国投新集	11	406	62	591	1101	17	31	43	23	31
918	601919	*ST 远洋	17	364	72	875	1418	30	43	42	23	28
919	601928	凤凰传媒	9	555	52	525	1106	13	34	62	29	44
920	601929	吉视传媒	11	345	78	405	848	15	34	53	26	39
921	601933	永辉超市	9	345	72	253	509	11	21	42	20	31
922	601939	建设银行	13	1711	25	3416	5392	23	35	38	23	23
923	601958	金钼股份	10	350	74	343	698	12	25	39	19	28
924	601965	中国汽研	13	196	115	194	407	14	33	51	23	38
925	601988	中国银行	18	2249	26	6481	8665	36	43	44	26	27
926	601989	中国重工	11	1788	26	2893	5765	19	36	49	27	32
927	601991	大唐发电	16	352	81	690	1236	23	39	45	24	30
928	601992	金隅股份	12	339	74	479	985	18	35	56	29	38
929	601996	丰林集团	12	252	97	311	641	15	36	61	28	47
930	601998	中信银行	14	801	39	1737	3093	25	43	48	27	30
931	601999	出版传媒	18	112	160	155	306	19	36	46	21	36
932	603000	人民网	7	433	56	181	356	8	23	50	20	42
933	603001	奥康国际	12	154	144	112	223	11	22	37	15	30
934	603002	宏昌电子	13	170	138	209	424	15	34	51	23	39
935	603003	龙宇燃油	18	104	179	108	219	16	34	54	22	46
936	603008	喜临门	20	99	189	117	231	18	35	47	20	40

序号	证券代码	证券名称	价格冲击 指数(基点)	流动性指 数(万元)	大宗交易 成本(基点)	五档订单 深度(万元)	十档订单 深度(万元)	相对买卖 价差(基点)	相对有效价 差(基点)	日内波动 率(基点)	超额波动 率(基点)	收益波动 率(基点)
937	603077	和邦股份	13	186	135	151	305	13	28	42	18	35
938	603123	翠微股份	17	107	147	133	254	16	30	36	16	29
939	603128	华贸物流	16	155	154	180	351	17	36	54	25	43
940	603167	渤海轮渡	14	156	140	181	352	15	28	39	17	31
941	603333	明星电缆	18	124	159	229	434	22	37	42	20	32
942	603366	日出东方	11	180	137	132	266	11	24	37	16	29
943	603399	新华龙	12	165	135	131	265	12	26	51	22	41
944	603766	隆鑫通用	14	176	125	192	387	15	29	47	21	37
945	603993	洛阳钼业	12	244	103	275	560	14	30	49	24	37