

上证指数季报

2014年1-3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. 1-2014. 3）	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
上证指数体系图	14
指标定义	16

本季度情况介绍

指数收盘（2014年3月31日）和一季度涨跌幅

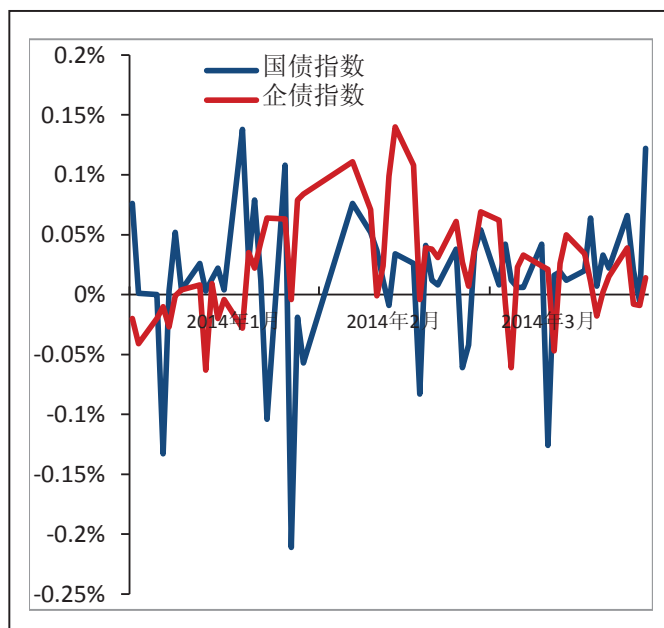
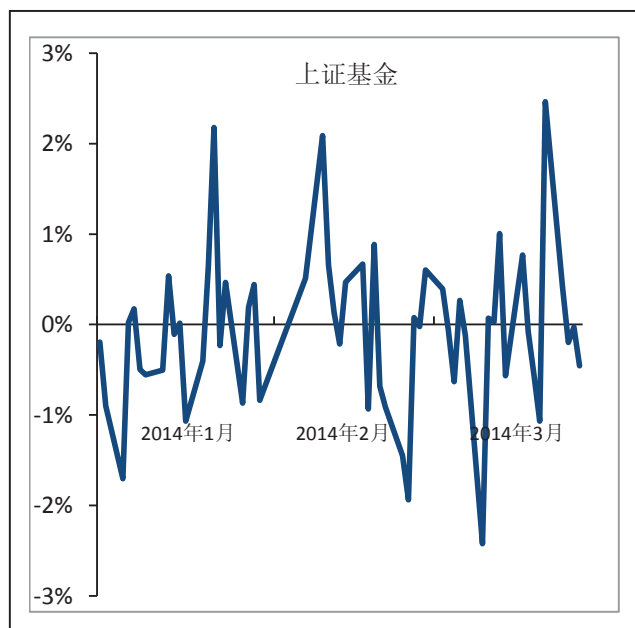
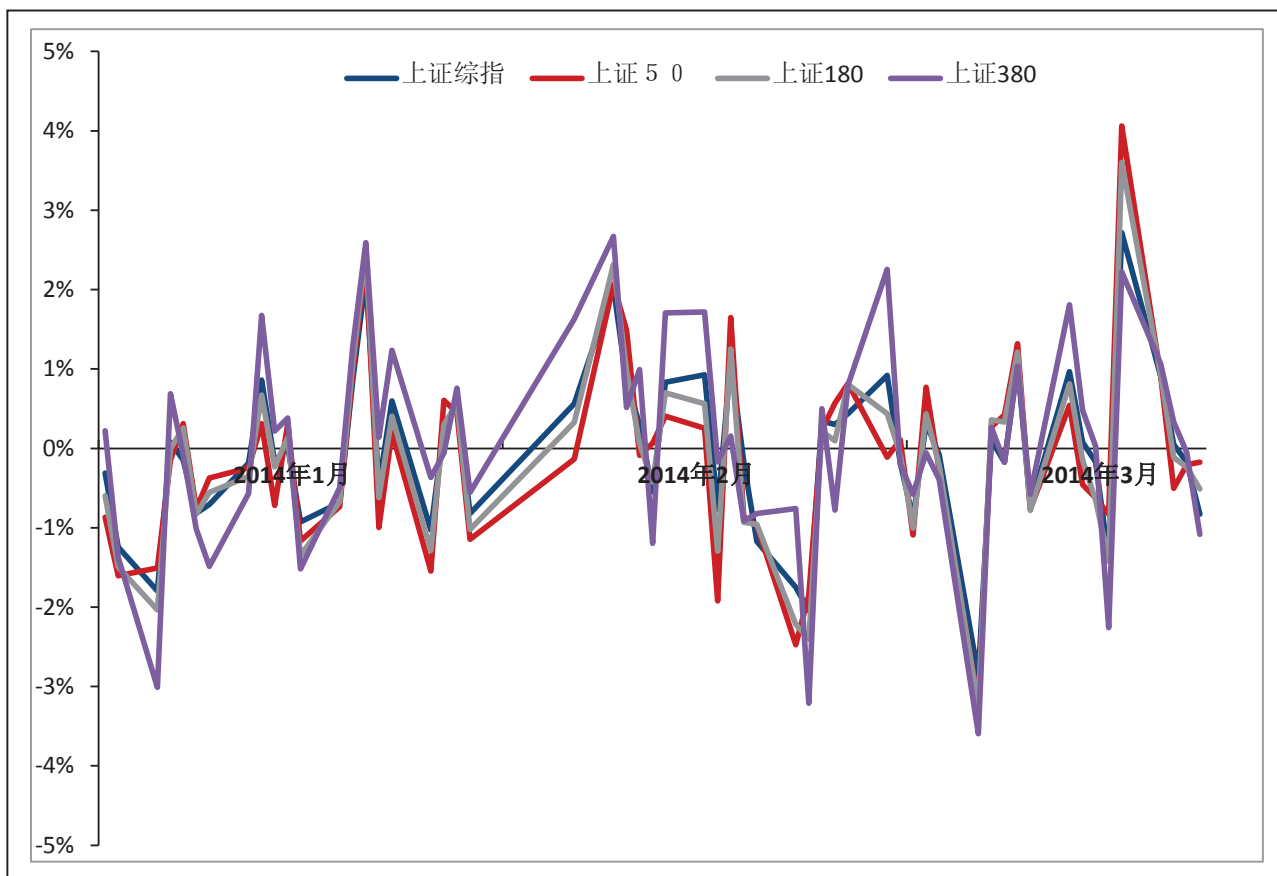
上证180指数	4694.38	-6.86%	上证企债指数	168.779	1.33%
上证50指数	1465.783	-6.92%	上证国债指数	140.539	0.73%
上证380指数	3323.381	-0.87%	上证基金指数	3694.297	-4.79%
上证综指指数	2033.306	-3.91%			

本季度180指数与上证综指的日收益率相关系数为97.45%，显示了较强的市场代表性。3月31日，上证180指数成份股的流通市值占上海A股市场的73%，总市值占70%，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84.11%，流通市值占上海A股市场的18%，总市值占上海A股市场的19%，覆盖了剩余市场的大部分。

上证180指数、上证50指数和上证380指数的每股收益分别为0.68元、0.75元和0.3元。3月末上证180指数、上证50指数和上证380指数的市盈率分别为8.04倍、7.33倍和20.28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10.18倍、9.46倍和23.86倍。

本季度上证电信指数涨幅7.133%，上证能源等权指数跌幅13.801%，分别在沪市A股指数体系中涨跌幅居前。

上证指数季度走势 (2014. 1-2014. 3)

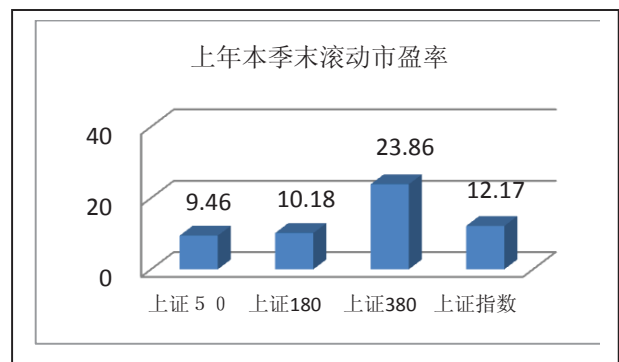
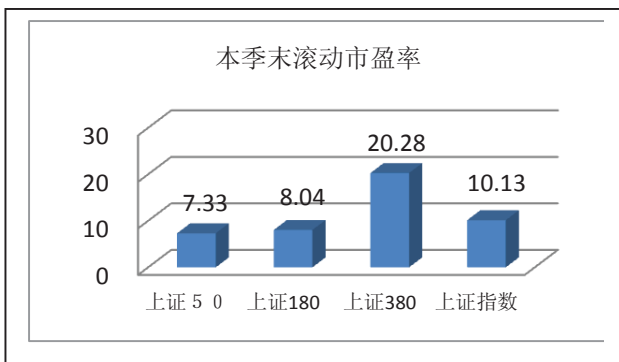


指数基本资料

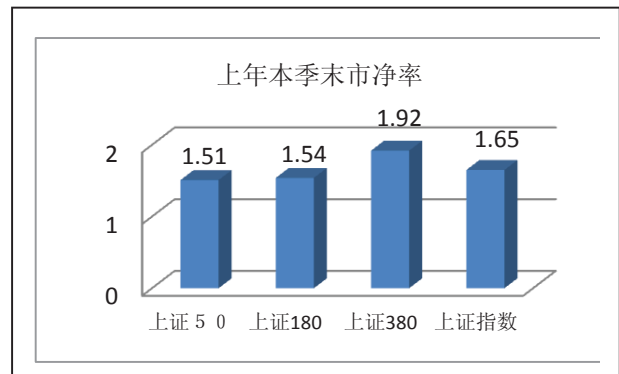
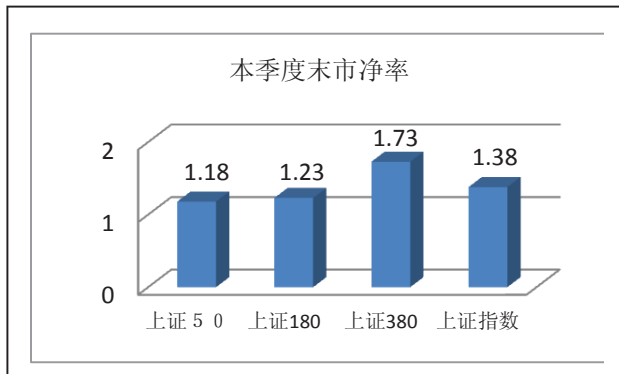
一、上证指数收益率和波动率

	累计收益%					日收益标准差%				
	1月	2月	3月	季度	上年本季	1月	2月	3月	季度	上年本季
上证50	-6.19	-0.88	0.10	-6.92	-3.47	0.95	1.26	1.28	1.18	1.85
上证180	-5.12	-1.03	-0.82	-6.86	-2.32	0.99	1.22	1.23	1.15	1.66
上证380	-1.50	2.72	-2.03	-0.87	6.00	1.22	1.41	1.36	1.33	1.33
上证指数	-3.92	1.14	-1.12	-3.91	-1.43	0.86	1.06	1.06	1.00	1.28

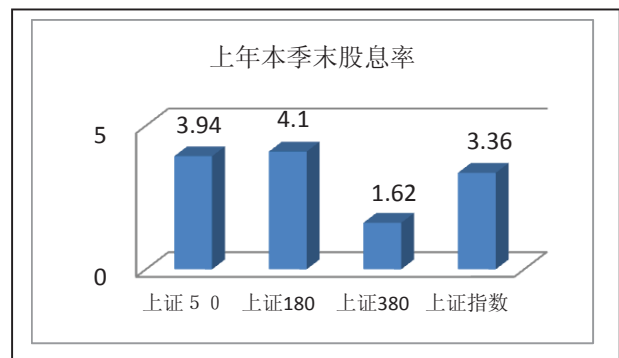
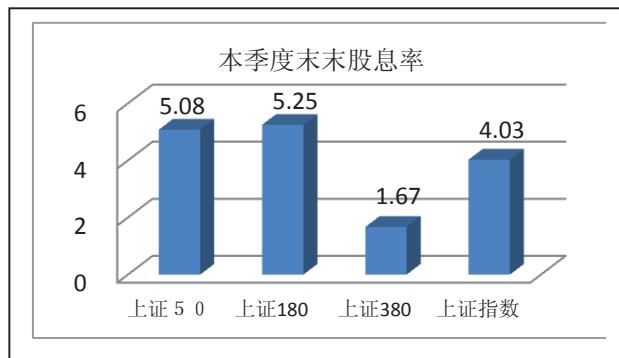
二、上证指数市盈率



三、上证指数市净率



四、上证指数股息率



五、上证指数市场基本指标

	上证 50	上证 180	上证 380	上证综指
指数总市值（万亿元）	7.12	10.31	2.80	14.77
指数总市值覆盖率%	48.00	70.00	19.00	100.00
指数流通市值（万亿元）	6.83	9.69	2.41	13.30
指数流通市值覆盖率%	52.00	73.00	18.00	100.00
样本股日均成交额（亿元）	3.72	2.25	0.74	0.87
换手率%	10.50	14.83	50.67	24.90
指数日收益相关系数	96.73	100.00	84.11	97.45

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）	9713.51	12777.51	1286.94	14009.44
股东权益（亿元）	60450.59	83796.51	16187.97	106424.00
每股收益（元）	0.75	0.68	0.30	0.54
每股净资产（元）	4.68	4.47	3.71	4.10
净资产收益率%	16.07	15.25	7.95	13.16
股东权益比率%	10.07	10.67	34.76	12.48
资产负债比率%	89.93	89.33	65.24	87.52
资产报酬率%	1.62	1.63	2.76	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	5	12.82	19570.84	87.50	28.64
原材料	8	4.73	2512.54	23.45	3.68
工业	9	3.86	5558.50	27.06	8.13
可选消费	2	1.24	1548.11	15.49	2.27
主要消费	2	2.90	2262.89	36.38	3.31
医药卫生	2	3.64	622.91	12.35	0.91
金融地产	21	20.00	35619.45	74.47	52.12
电信业务	1	6.25	648.62	47.65	0.95

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	12	30.77	20951.47	93.67	21.63
原材料	23	13.61	5483.92	51.18	5.66
工业	33	14.16	9668.23	47.08	9.98
可选消费	16	9.94	4243.77	42.46	4.38
主要消费	12	17.39	3754.25	60.36	3.87
医药卫生	9	16.36	2443.50	48.44	2.52
金融地产	58	55.24	45970.95	96.11	47.45
信息技术	7	13.21	1169.02	33.37	1.21
电信业务	2	12.50	776.19	57.02	0.80
公用事业	8	16.67	2423.81	51.16	2.50

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	38.46	1182.94	5.29	4.92
原材料	62	36.69	3019.60	28.18	12.56
资本品	80	46.24	5540.60	39.10	23.04
商业服务与商业用品	5	62.50	260.96	72.41	1.09
运输	30	57.69	2157.73	35.92	8.97
汽车与汽车零部件	15	39.47	729.55	21.06	3.03
耐用消费品与服装	14	28.57	871.53	35.64	3.62
消费者服务	4	26.67	188.28	17.73	0.78
媒体	9	64.29	937.22	68.34	3.90
零售业	26	57.78	1123.85	68.01	4.67
食品与主要用品零售	7	53.85	771.35	66.31	3.21
食品、饮料与烟草	16	30.77	815.42	17.13	3.39
家庭与个人用品	2	50.00	60.85	20.53	0.25
医疗保健设备与服务	1	33.33	162.20	63.14	0.67
制药、生物科技和生	28	53.85	1872.27	39.11	7.78
房地产	15	20.27	745.26	15.90	3.10
软件与服务	9	52.94	670.03	49.78	2.79
技术硬件与设备	8	32.00	397.06	25.31	1.65
半导体产品与设备	6	54.55	378.11	64.27	1.57
通信设备	5	33.33	289.50	40.62	1.20
公用事业	23	47.92	1876.10	39.60	7.80

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	40	23479.88	22464.68
原材料	176	12316.23	10798.18
工业	249	24248.21	20732.97
可选消费	173	13132.36	10112.58
主要消费	72	7056.96	6245.17
医药卫生	57	5475.01	5052.62
金融地产	111	50240.48	47935.51
信息技术	56	4202.65	3529.72
电信业务	18	1461.93	1376.18
公用事业	49	6127.85	4745.18

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%
600747	大连控股	44.85	600598	*ST 大荒	-38.37
600759	正和股份	37.64	600188	兖州煤业	-27.82
600340	华夏幸福	37.62	600702	沱牌舍得	-26.66
600588	用友软件	24.78	601699	潞安环能	-26.34
600352	浙江龙盛	23.00	600597	光明乳业	-24.50
600519	贵州茅台	20.50	600546	山煤国际	-24.24
601998	中信银行	19.64	600150	中国船舶	-23.52
600886	国投电力	17.05	601808	中海油服	-22.80
600418	江淮汽车	16.84	600157	永泰能源	-22.45
600832	东方明珠	16.07	600123	兰花科创	-22.31

上证 50 指数

代码	简称	涨幅%	代码	简称	跌幅%
600519	贵州茅台	20.50	601699	潞安环能	-26.34
600028	中国石化	12.28	601117	中国化学	-22.25
600383	金地集团	3.59	600999	招商证券	-20.11
600000	浦发银行	3.08	600837	海通证券	-18.37
601169	北京银行	1.07	600030	中信证券	-17.41
			601989	中国重工	-16.58
			600256	广汇能源	-16.13
			601688	华泰证券	-15.40
			601601	中国太保	-14.73
			600031	三一重工	-13.40

上证 380 指数

代码	简称	涨幅%	代码	简称	跌幅%
600776	东方通信	86.69	600292	中电远达	-29.16
600662	强生控股	69.67	600704	物产中大	-26.96
601000	唐山港	58.17	600783	鲁信创投	-25.84
601929	吉视传媒	45.29	601001	大同煤业	-25.78
600846	同济科技	43.23	601666	平煤股份	-24.71
600371	万向德农	43.06	600971	恒源煤电	-24.12
600787	中储股份	32.00	601918	国投新集	-22.36
600246	万通地产	31.85	600403	大有能源	-21.91
600432	吉恩镍业	31.31	601011	宝泰隆	-21.36
600884	杉杉股份	30.03	600527	江南高纤	-20.77

上证综指

代码	简称	涨幅%	代码	简称	跌幅%
600155	宝硕股份	137.87	600598	*ST 大荒	-38.37
600776	东方通信	86.69	900912	外高 B 股	-33.07
600606	金丰投资	70.17	900948	伊泰 B 股	-31.83
600662	强生控股	69.67	600119	长江投资	-31.58
603005	晶方科技	65.71	600860	*ST 京城	-31.43
600680	上海普天	60.50	600292	中电远达	-29.16
601000	唐山港	58.17	600188	兖州煤业	-27.82
603308	应流股份	48.43	600745	中茵股份	-27.46
600452	涪陵电力	48.11	600704	物产中大	-26.96
601929	吉视传媒	45.29	600691	阳煤化工	-26.77

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)
600000	浦发银行	669.09	600000	浦发银行	71.77
601318	中国平安	666.94	601818	光大银行	68.40
600030	中信证券	511.46	600016	民生银行	66.23
600109	国金证券	502.94	601288	农业银行	54.60
600016	民生银行	499.57	601668	中国建筑	53.77
601166	兴业银行	458.02	601998	中信银行	49.80
600837	海通证券	396.43	600050	中国联通	49.73
600887	伊利股份	357.82	601166	兴业银行	48.74
600804	鹏博士	340.40	601989	中国重工	47.77
600036	招商银行	337.72	600030	中信证券	45.82

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)
600000	浦发银行	669.09	600000	浦发银行	71.77
601318	中国平安	666.94	601818	光大银行	68.40
600030	中信证券	511.46	600016	民生银行	66.23
600016	民生银行	499.57	601288	农业银行	54.60
601166	兴业银行	458.02	601668	中国建筑	53.77
600837	海通证券	396.43	600050	中国联通	49.73
600887	伊利股份	357.82	601166	兴业银行	48.74
600036	招商银行	337.72	601989	中国重工	47.77
600519	贵州茅台	334.44	600030	中信证券	45.82
600048	保利地产	314.33	600028	中国石化	44.87

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)
600839	四川长虹	331.27	600839	四川长虹	94.84
600718	东软集团	281.18	600688	上海石化	53.39
600846	同济科技	209.20	600846	同济科技	26.43
600388	龙净环保	202.81	600667	太极实业	20.53
600522	中天科技	191.63	601333	广深铁路	19.56
600688	上海石化	191.21	600718	东软集团	18.72
600648	外高桥	182.85	601000	唐山港	18.61
600879	航天电子	167.90	600175	美都控股	17.07
600626	申达股份	166.66	600879	航天电子	16.94
600551	时代出版	163.96	600626	申达股份	16.78

上证综指

代码	简称	成交金额 (亿元)	代码	简称	成交股数 (亿股)
600000	浦发银行	669.09	600839	四川长虹	94.84
601318	中国平安	666.94	600000	浦发银行	71.77
600030	中信证券	511.46	601818	光大银行	68.40
600109	国金证券	502.94	600016	民生银行	66.23
600016	民生银行	499.57	601288	农业银行	54.60
601166	兴业银行	458.02	601668	中国建筑	53.77
600837	海通证券	396.43	600688	上海石化	53.39
600887	伊利股份	357.82	601998	中信银行	49.80
600804	鹏博士	340.40	600050	中国联通	49.73
600036	招商银行	337.72	601166	兴业银行	48.74

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	12306.08	能源	62.86	17.58	58.55	12.41
601398	工商银行	9128.51	金融地产	24.96	13.04	19.42	9.21
601288	农业银行	7116.14	金融地产	19.46	10.17	15.14	7.18
600028	中国石化	4579.91	能源	23.39	6.54	21.79	4.62
601628	中国人寿	2796.60	金融地产	7.65	4.00	5.95	2.82
601088	中国神华	2280.71	能源	11.65	3.26	10.85	2.30
600036	招商银行	2025.76	金融地产	5.54	2.89	4.31	2.04
601166	兴业银行	1813.78	金融地产	4.96	2.59	3.86	1.83
601318	中国平安	1797.78	金融地产	4.92	2.57	3.82	1.81
600016	民生银行	1730.26	金融地产	4.73	2.47	3.68	1.74

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%
601898	中煤能源	403.60	能源	33.02	1.63
601727	上海电气	385.16	资本品	6.75	1.55
601991	大唐发电	370.79	公用事业	19.25	1.49
601018	宁波港	294.40	运输	13.42	1.19
601618	中国中冶	272.82	资本品	4.78	1.10
600998	九州通	257.54	食品与主要用品零售	29.94	1.04
601158	重庆水务	257.28	公用事业	13.36	1.04
601877	正泰电器	246.86	资本品	4.33	0.99
601098	中南传媒	232.22	媒体	24.73	0.94
600648	外高桥	221.27	资本品	3.88	0.89

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	12306.08	12306.08	能源
601398	工商银行	9128.51	9128.51	金融地产
601288	农业银行	7116.14	6876.76	金融地产
601988	中国银行	5069.72	5069.72	金融地产
600028	中国石化	4579.91	4579.91	能源
601628	中国人寿	2796.60	2796.60	金融地产
601088	中国神华	2280.71	2280.71	能源
600036	招商银行	2025.76	2025.76	金融地产
601166	兴业银行	1813.78	1540.30	金融地产
600000	浦发银行	1813.12	1450.49	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	8	1.67	337.39	2.45
50~100 亿元	27	11.84	2050.81	12.80
100~500 亿	109	53.43	26860.06	62.71
500~1000 亿	18	94.74	13218.85	95.89
1000~5000 亿	14	100.00	27048.79	100.00
5000 亿元以上	4	100.00	33620.46	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	21	7114.18	16.61	10.29
500~1000 亿	13	9940.95	72.11	68.42
1000~5000 亿	13	25571.58	94.54	92.86
5000 亿元以上	3	75.00	28550.73	84.92

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	44	16.48	1069.54	19.00
30~50 亿	109	51.42	4189.27	51.60
50~100 亿	153	67.11	10676.57	66.62
100~200 亿	58	49.57	7752.54	48.05
200~500 亿	16	18.39	4310.95	16.14
500 亿元以上	0	0.00	0.00	0.00

上证综指	股票数目	总市值 (亿元)	自由流通市值 (亿元)
规模分布			
30 亿元以下	316	6089.66	5718.79
30~50 亿	215	8236.54	7153.53
50~100 亿	229	16125.40	13628.45
100~200 亿	117	16133.48	13177.32
200~500 亿	87	26702.04	22350.39
500 亿元以上	37	74454.45	70964.33

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 (2014.03.31)	季度涨跌%
上证 180 系列							
000010	上证 180	5057.49	2014-02-20	4526.831	2014-03-21	4694.38	-6.86
000016	上证 50	1570.05	2014-01-02	1402.182	2014-03-21	1465.78	-6.92
000018	180 金融	2967.04	2014-01-02	2621.102	2014-03-19	2765.83	-7.09
000021	180 治理	588.78	2014-01-02	522.496	2014-03-21	545.98	-7.51
000025	180 基建	1085.15	2014-01-02	961.687	2014-03-12	1014.69	-6.52
000026	180 资源	2201.69	2014-01-02	1960.198	2014-03-21	2016.49	-8.59
000027	180 运输	808.70	2014-02-17	671.828	2014-03-14	709.27	-10.06
000043	超大盘	1438.29	2014-01-02	1309.276	2014-03-21	1358.46	-5.75
000044	上证中盘	2390.78	2014-02-20	2110.454	2014-03-21	2163.61	-6.75
000050	50 等权	1530.44	2014-01-02	1364.934	2014-03-21	1416.05	-7.49
000054	上证海外	746.21	2014-01-02	660.338	2014-03-21	689.77	-7.82
上证 180 风格指数							
000028	180 成长	1901.23	2014-02-20	1714.806	2014-03-11	1791.69	-4.35
000029	180 价值	2115.45	2014-01-02	1892.099	2014-03-12	2013.76	-5.10
000030	180R 成长	1383.87	2014-02-20	1227.846	2014-03-21	1261.57	-6.89
000031	180R 价值	1710.36	2014-01-02	1520.679	2014-03-11	1597.47	-6.84
上证规模指数							
000009	上证 380	3596.51	2014-02-20	3117.345	2014-01-13	3323.38	-0.87
000045	上证小盘	3104.40	2014-02-20	2700.069	2014-01-13	2859.59	-1.46
000046	上证中小	2718.43	2014-02-20	2410.052	2014-01-20	2483.02	-4.13
000047	上证全指	2044.07	2014-02-20	1838.314	2014-03-12	1893.57	-5.43
上证全指风格指数							
000057	全指成长	2179.57	2014-02-20	1967.426	2014-03-11	2043.19	-4.73
000058	全指价值	2089.52	2014-02-20	1875.27	2014-03-12	1981.37	-5.11
000059	全 R 成长	2028.15	2014-02-20	1819.221	2014-03-21	1855.05	-5.13
000060	全 R 价值	2031.76	2014-02-20	1820.626	2014-03-12	1902.75	-5.69
上证行业指数							
000032	上证能源	1538.86	2014-01-02	1338.778	2014-03-21	1371.57	-11.08
000033	上证材料	1418.37	2014-02-17	1282.679	2014-03-10	1341.03	-4.65
000034	上证工业	1454.90	2014-02-20	1275.941	2014-03-21	1314.39	-9.46
000035	上证可选	2209.19	2014-02-20	1868.101	2014-01-13	1941.84	-2.22
000036	上证消费	4369.43	2014-01-02	3993.98	2014-02-26	4033.97	-8.00
000037	上证医药	4596.91	2014-02-25	4077.925	2014-01-20	4131.31	-4.66
000038	上证金融	2810.02	2014-01-02	2478.857	2014-03-19	2630.13	-6.75
000039	上证信息	2722.18	2014-02-25	2246.553	2014-01-14	2350.04	0.21
000040	上证电信	1892.85	2014-03-07	1477.152	2014-01-13	1699.33	7.13
000041	上证公用	1500.50	2014-02-20	1374.583	2014-01-13	1439.51	-2.25

代码	简称	最高 (日期)		最低 (日期)		收盘 (2014. 03. 31)	季度涨跌%
上证行业策略指数							
000070	能源等权	2420.37	2014-01-02	2042.95	2014-03-11	2093.41	-13.80
000071	材料等权	2019.13	2014-02-20	1834.443	2014-03-10	1901.00	-4.28
000072	工业等权	1824.40	2014-02-20	1620.719	2014-03-12	1660.45	-7.89
000073	可选等权	2357.39	2014-02-20	1943.686	2014-01-13	2078.59	0.80
000074	消费等权	4310.55	2014-01-02	3824.744	2014-03-31	3851.16	-10.93
000075	医药等权	5894.94	2014-02-19	5226.608	2014-01-20	5385.24	-2.99
000076	金融等权	2801.81	2014-02-20	2511.622	2014-03-19	2653.95	-5.30
000077	信息等权	3364.92	2014-02-25	2723.267	2014-01-14	2916.80	2.32
000078	电信等权	1592.47	2014-03-07	1309.247	2014-01-13	1465.10	3.63
000079	公用等权	1794.72	2014-02-20	1601.622	2014-01-13	1680.87	-3.37
上证央企、民企、国企主题指数							
000042	上证央企	960.91	2014-01-02	851.793	2014-03-21	885.10	-8.07
000049	上证民企	1167.42	2014-02-20	1031.027	2014-01-20	1058.28	-4.25
000055	上证地企	723.24	2014-02-20	643.183	2014-03-11	676.86	-5.98
000056	上证国企	641.15	2014-01-02	572.083	2014-03-12	597.07	-7.14
上证其他主题指数							
000015	红利指数	1723.53	2014-02-20	1560.538	2014-03-12	1616.13	-3.89
000048	责任指数	792.58	2014-02-20	707.82	2014-03-21	738.51	-5.97
000062	上证沪企	1587.18	2014-02-20	1395.259	2014-03-11	1461.04	-6.74
000063	上证周期	1933.66	2014-01-02	1706.296	2014-03-19	1798.44	-7.26
000064	非周期	1798.13	2014-02-20	1599.102	2014-03-21	1624.23	-6.38
000065	上证龙头	1966.64	2014-01-02	1769.111	2014-03-12	1852.84	-6.07
000066	上证商品	1415.17	2014-01-02	1263.047	2014-03-21	1289.55	-9.11
000067	上证新兴	5041.21	2014-02-18	4345.987	2014-01-14	4439.97	-3.87
000068	上证资源	1686.22	2014-02-20	1495.407	2014-03-21	1530.95	-8.85
000069	消费 80	2804.91	2014-02-20	2496.914	2014-01-20	2527.68	-5.18
上证综合类指数							
000001	上证指数	2177.98	2014-02-20	1974.382	2014-03-12	2033.31	-3.91
000002	A 股指数	2280.18	2014-02-20	2066.879	2014-03-12	2128.79	-3.87
000003	B 股指数	253.59	2014-01-02	221.461	2014-03-21	224.99	-11.29
000004	工业指数	1828.83	2014-02-20	1640.802	2014-01-20	1690.91	-2.79
000005	商业指数	2743.60	2014-02-20	2295.351	2014-01-13	2474.32	-1.75
000006	地产指数	3343.14	2014-01-02	2923.18	2014-03-11	3158.51	-5.70
000007	公用指数	3594.73	2014-01-02	3224.395	2014-03-12	3352.71	-6.79
000008	综合指数	1866.22	2014-02-20	1687.441	2014-03-11	1764.34	-4.68
000017	新综指	1838.86	2014-02-20	1666.705	2014-03-12	1716.64	-3.88
000020	中型综指	920.88	2014-02-19	793.061	2014-01-13	850.01	0.25
000090	上证流通	743.84	2014-02-20	671.748	2014-01-20	691.03	-4.31
上证行业指数固定收益指数							
000012	国债指数	140.55	2014-03-31	139.423	2014-01-08	140.54	0.73
000013	企债指数	168.79	2014-03-31	166.05	2014-01-20	168.78	1.33
000022	沪公司债	147.38	2014-03-19	145.175	2014-01-21	147.31	0.79
000023	沪分离债	143.91	2014-03-03	139.299	2014-01-06	143.46	2.60
000061	沪企债 30	125.03	2014-03-13	121.116	2014-01-09	124.80	1.93
上证基金类指数							
000011	基金指数	3949.53	2014-02-20	3624.314	2014-03-21	3694.30	-4.79

指数衍生品

指数名称	产品名称	交易所	产品代码	资产净值(亿元)
ETF				
上证 50 指数	华夏上证 50ETF	上海证券交易所	510050	204.12
上证 180 指数	华安上证 180ETF	上海证券交易所	510180	116.83
上证红利指数	华泰柏瑞上证红利 ETF	上海证券交易所	510880	10.66
上证 50 指数	野村上证 50ETF	大阪证券交易所	1309.0	5.51
上证 50 指数	标智上证 50ETF	香港交易所	3024.HK	1.04
上证央企 50 指数	工银瑞信上证中央企业 50ETF	上海证券交易所	510060	4.60
上证 180 公司治理指数	交银施罗德上证 180 公司治理 ETF	上海证券交易所	510010	18.11
上证 50 指数	大华上证 50 中国挂牌基金	新加坡交易所	USSE50.SP	2.18
上证超级大盘指数	博时上证超大盘 ETF	上海证券交易所	510020	6.49
上证中盘指数	易方达上证中盘 ETF	上海证券交易所	510130	6.32
上证 180 价值指数	华宝兴业上证 180 价值 ETF	上海证券交易所	510030	7.73
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	3.04
上证民企 50 指数	鹏华上证民企 50ETF	上海证券交易所	510070	2.35
上证周期行业 50 指数	海富通上证周期行业 50ETF	上海证券交易所	510110	1.71
上证龙头企业指数	华安上证龙头企业 ETF	上海证券交易所	510190	4.53
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	2.75
上证 50 指数	标智上证 50 中国指数基金	台湾证券交易所	008201.TW	--
上证消费 80 指数	招商上证消费 80ETF	上海证券交易所	510150	8.46
上证中小盘指数	华泰柏瑞上证中小盘 ETF	上海证券交易所	510220	0.65
上证综指	富国上证综指 ETF	上海证券交易所	510210	2.59
上证 180 金融指数	国泰上证 180 金融 ETF	上海证券交易所	510230	14.64
上证新兴产业指数	诺安上证新兴产业 ETF	上海证券交易所	510260	4.03
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	1.71
上证国企 100 指数	中银上证国企 100ETF	上海证券交易所	510270	0.52
上证 180 成长指数	华宝兴业上证 180 成长 ETF	上海证券交易所	510280	2.41
上证 380 指数	南方上证 380ETF	上海证券交易所	510290	1.69
上证 180 指数	富邦上证 180ETF	台湾证券交易所	006205.TW	18.32
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	1.58
上证 50 指数	元大宝来上证 50ETF	台湾证券交易所	--	10.70
上证 180 等权重指数	景顺长城上证 180 等权重 ETF	上海证券交易所	510420	0.90
上证 50 等权重指数	银华上证 50 等权重 ETF	上海证券交易所	510430	0.30
上证 5 年期国债指数	国泰上证 5 年期国债 ETF	上海证券交易所	511010	7.87
上证能源指数	华夏上证能源发起式 ETF	上海证券交易所	510610	1.11
上证原材料指数	华夏上证原材料发起式 ETF	上海证券交易所	510620	1.06
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	3.03
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	1.95
上证医药卫生指数	华夏上证医药卫生发起式 ETF	上海证券交易所	510660	3.58
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	1.03
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	0.32
上证企债 30 指数	博时上证企债 30ETF	上海证券交易所	511210	13.22
上证 380 指数	万家上证 380ETF	上海证券交易所	510680	0.55
指数基金				
上证 A 股指数	景福证券投资基金	--	184701	27.61
上证 180 指数	万家 180 指数证券投资基金	--	519180	27.82
上证 50 指数	易方达 50 指数证券投资基金	--	110003	124.67
上证综合指数	汇添富上证综合指数证券投资基金	--	470007	36.44
上证 50 指数	中海上证 50 指数增强型证券投资基金	--	399001	1.56
上证 380 指数	中海上证 380 指数基金	--	399011	0.19
上证 380 指数	中邮上证 380 指数增强型证券投资基金	--	590007	0.22

上证指数体系图

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。

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

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;

TNA_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



地址：上海市浦东南路528号 邮编：200120

电话：021-68805258 传真：021-68805257 网站：www.sse.com.cn



上海市迎春路555号B栋5楼 邮编：200135

电话：021-50185500 传真：021-50186368 网站：www.csindex.com.cn