

上证指数季报

2015年10-12月



 上海證券交易所
SHANGHAI STOCK EXCHANGE

 中证指数有限公司
CHINA SECURITIES INDEX CO., LTD

编

目录

本季度情况介绍	1
上证指数季度走势图（2015.10-2015.12）	2
指数基本资料	3
一、上证指数收益率和波动率	3
二、上证指数市盈率	3
三、上证指数市净率	3
四、上证指数股息率	3
五、上证指数市场基本指标	4
六、上证指数财务基本指标	4
指数行业分布比较	4
一、上证 50 指数行业分布	4
二、上证 180 指数行业分布	5
三、上证 380 指数行业分布	5
四、上证综合指数行业分布	6
样本股表现	6
一、本季度十大涨跌成分股	6
二、本季度十大成交成分股	7
三、季度末十大权重成分股	9
四、季度末样本分布	10
上证系列指数概况	11
一、上证系列指数季度表现	11
指数衍生品	13
指标定义	14

本季度情况介绍

指数收盘（2015年12月31日）和四季度涨跌幅

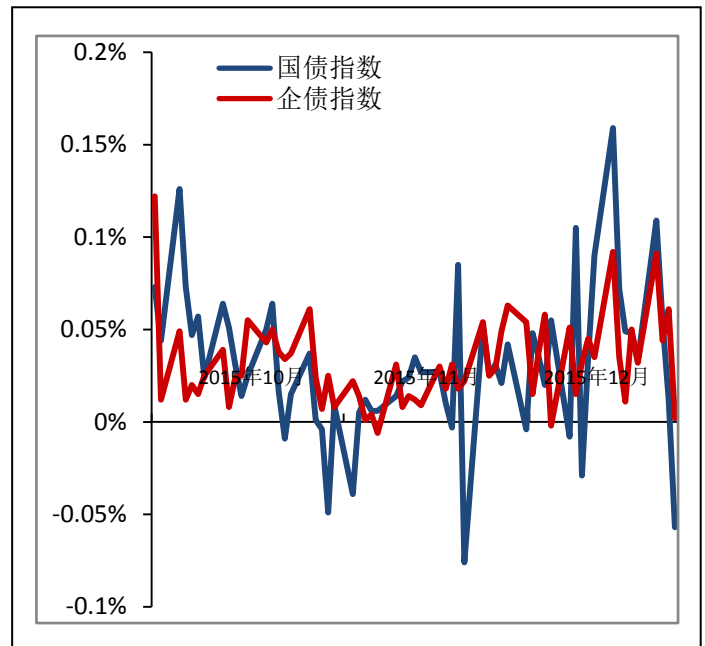
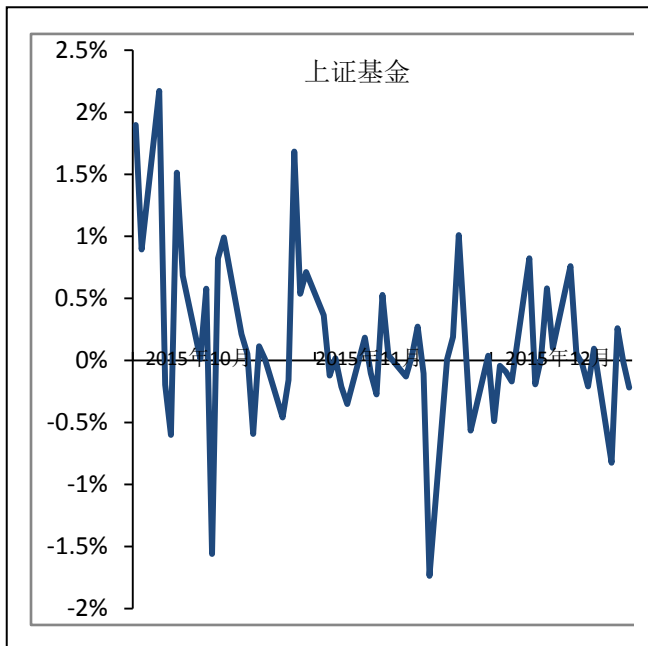
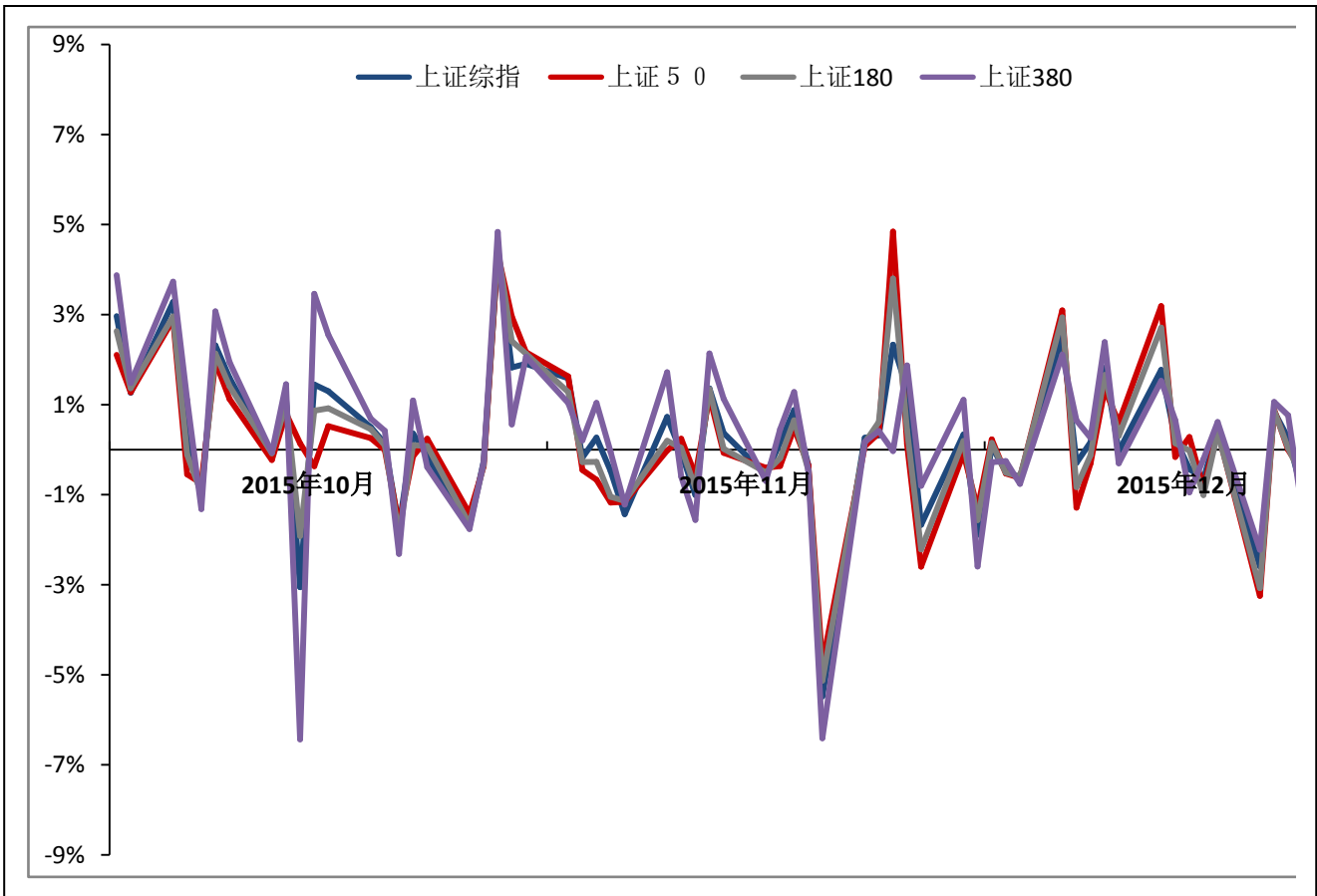
上证180指数	7955.97	13.72%	上证企债指数	197.12	1.96%
上证50指数	2420.80	12.80%	上证国债指数	154.54	1.93%
上证380指数	6712.76	22.72%	上证基金指数	5904.92	9.29%
上证综指指数	3539.18	15.93%			

本季度180指数与上证综指的日收益率相关系数为96.69%，显示了较强的市场代表性。12月31日，上证180指数成份股的流通市值占上海A股市场的68%，总市值占63%，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81.39%，流通市值占上海A股市场的19%，总市值占上海A股市场的20%，覆盖了剩余市场的大部分。

上证180指数、上证50指数和上证380指数的每股收益分别为0.65元、0.72元和0.3元。12月末上证180指数、上证50指数和上证380指数的市盈率分别为12.85倍、10.62倍和42.91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12.36倍、10.94倍和29.95倍。

本季度上证电信指数涨幅38.088%，在沪市A股指数体系中涨幅居前。

上证指数季度走势 (2015.10-2015.12)

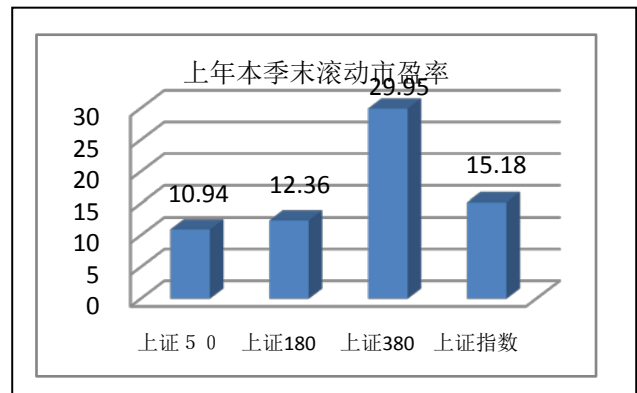
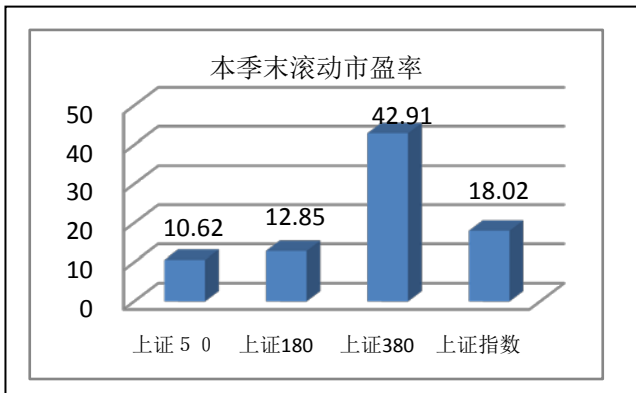


指数基本资料

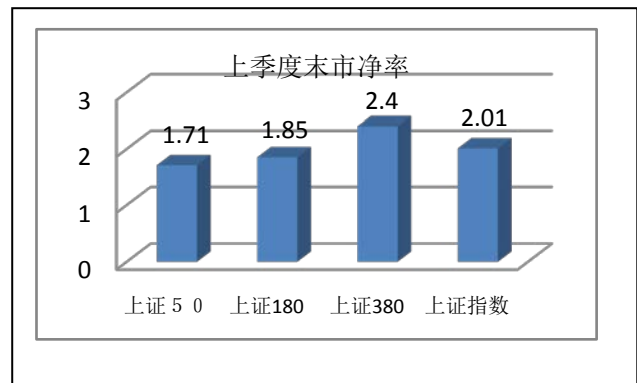
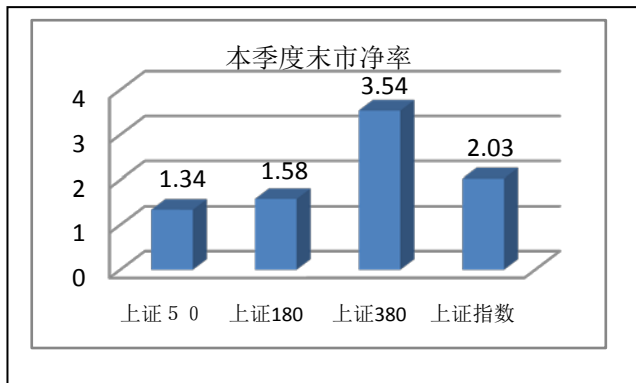
一、上证指数收益率和波动率

	累计收益%					日收益标准差%				
	10月	11月	12月	季度	上年本季	10月	11月	12月	季度	上年本季
上证50	7.78	1.01	3.62	12.80	59.39	1.11	1.77	1.72	1.60	2.09
上证180	9.31	0.56	3.46	13.72	50.60	1.34	1.79	1.53	1.59	1.77
上证380	14.78	3.21	3.59	22.72	16.15	2.48	2.06	1.25	1.96	1.45
上证指数	10.80	1.86	2.72	15.93	36.84	1.56	1.80	1.25	1.56	1.53

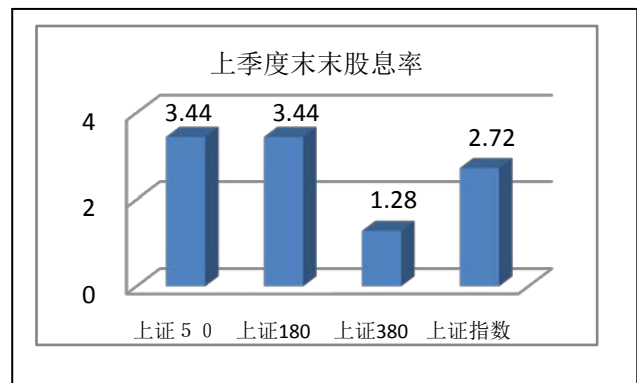
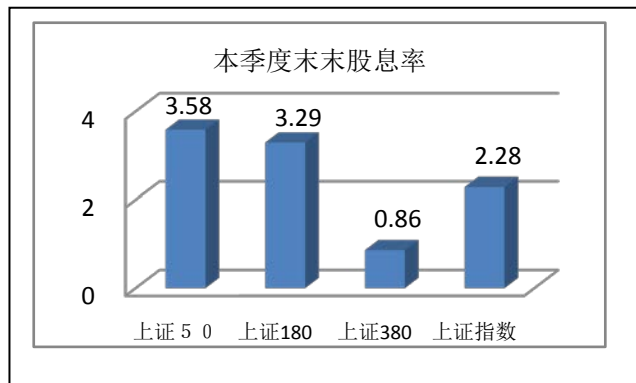
二、上证指数市盈率



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)	12.78	18.52	5.98	29.52
指数总市值覆盖率%	43	63	20	100
指数流通市值 (万亿元)	12.04	17.19	4.8	25.41
指数流通市值覆盖率%	48	68	19	100
样本股日均成交额 (亿元)	12.15	7.81	3.13	3.33
换手率%	19.96	34.16	143.32	65.79
指数日收益相关系数	96.65	100	81.39	96.69

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)	12020.50	14273.57	1269.55	15609.30
股东权益 (亿元)	95113.03	116954.83	16875.38	145169.01
每股收益 (元)	0.72	0.65	0.30	0.52
每股净资产 (元)	5.71	5.31	3.97	4.80
净资产收益率%	12.64	12.20	7.52	10.75
股东权益比率%	10.12	11.42	38.30	13.08
资产负债比率%	89.88	88.58	61.70	86.92
资产报酬率%	1.28	1.39	2.88	1.41

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	3	7.14	20728.87	80.13	17.22
原材料	3	1.63	1563.37	7.75	1.30
工业	11	4.09	15469.45	30.77	12.85
可选消费	2	1.07	3157.46	13.18	2.62
主要消费	3	3.66	4474.63	37.78	3.72
金融地产	25	22.32	72622.49	82.11	60.32
电信业务	1	6.25	1309.95	36.48	1.09
公用事业	2	3.77	1071.35	10.33	0.89

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	9	21.43	22,861.44	88.37	13.30
原材料	18	9.78	7,313.20	36.24	4.25
工业	39	14.50	28,630.04	56.95	16.65
可选消费	19	10.16	9,163.73	38.26	5.33
主要消费	11	13.41	6,610.69	55.81	3.85
医药卫生	8	13.33	3,523.61	41.23	2.05
金融地产	58	51.79	83,769.29	94.71	48.73
信息技术	7	10.45	2992.64	30.53	1.74
电信业务	2	12.50	1,746.36	48.63	1.02
公用事业	9	16.98	5,292.52	51.02	3.08

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	14	33.33	1,561.53	6.04	3.26
原材料	60	32.61	6,787.49	33.63	14.15
资本品	78	40.00	9,064.24	26.04	18.90
商业服务与商业用品	9	45.00	866.14	57.55	1.81
运输	27	50.00	4,426.26	31.73	9.23
汽车与汽车零部件	16	34.78	2,766.82	32.32	5.77
耐用消费品与服装	16	26.23	1,808.30	31.03	3.77
消费者服务	6	35.29	1183.69	70.87	2.47
媒体	6	28.57	1,155.34	29.00	2.41
零售业	19	45.24	2,033.23	51.99	4.24
食品与主要用品零售	4	25.00	368.90	13.43	0.77
食品、饮料与烟草	20	32.26	1,867.72	21.64	3.89
家庭与个人用品	1	25.00	66.98	14.43	0.14
医疗保健设备与服务	1	20.00	133.09	31.73	0.28
制药、生物科技和生	27	49.09	3,493.74	42.99	7.29
房地产	16	21.05	1674.04	13.92	3.49
软件与服务	9	42.86	1665.64	41.91	3.47
技术硬件与设备	14	42.42	1647.26	39.90	3.43
半导体产品与设备	7	53.85	1058.07	62.27	2.21
通信设备	6	40.00	972.99	42.65	2.03
公用事业	24	45.28	3,354.51	32.34	6.99

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	43	28,265.01	25,948.88
原材料	193	24,283.92	20,338.34
工业	284	59,468.07	50,642.79
可选消费	199	29,693.79	24,206.90
主要消费	85	15,075.82	11,892.65
医药卫生	61	9,994.41	8,553.55
金融地产	117	97,016.01	88,665.58
信息技术	69	12,219.56	9,850.60
电信业务	18	4,125.41	3,627.16
公用事业	55	15052.20	10401.39

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%
600718	东软集团	123.54	601618	中国中冶	-22.72
600085	同仁堂	98.53	601919	中国远洋	-22.44
601198	东兴证券	90.77	600643	爱建集团	-12.43
600816	安信信托	58.46	600170	上海建工	-11.39
600516	方大炭素	55.02	601106	中国一重	-8.18
600503	华丽家族	53.42	600820	隧道股份	-8.12
600895	张江高科	51.58	600005	武钢股份	-7.71
601901	方正证券	51.18	600018	上港集团	-7.03
601788	光大证券	48.00	601989	中国重工	-6.09
601099	太平洋	47.23	600208	新湖中宝	-5.54

上证 50 指数

代码	简称	涨幅%	代码	简称	跌幅%
601901	方正证券	51.18	600018	上港集团	-7.03
601336	新华保险	45.72	601989	中国重工	-6.09
600958	东方证券	43.00	600795	国电电力	-2.48
600030	中信证券	42.49	601006	大秦铁路	-2.38
601688	华泰证券	41.67	600150	中国船舶	-1.50
600999	招商证券	39.36	601186	中国铁建	-0.52
600109	国金证券	33.22	601390	中国中铁	-0.18
600048	保利地产	33.17	601766	中国中车	-0.01
601601	中国太保	30.06			
601211	国泰君安	29.13			

上证380指数

代码	简称	涨幅%	代码	简称	跌幅%
600756	浪潮软件	167.86	600634	中技控股	-42.30
600667	太极实业	108.80	600058	五矿发展	-39.16
600173	卧龙地产	104.08	600277	亿利洁能	-37.79
600673	东阳光科	97.48	600428	中远航运	-28.00
600160	巨化股份	90.97	600499	科达洁能	-23.65
600716	凤凰股份	87.56	600750	江中药业	-23.08
600487	亨通光电	84.70	600026	中海发展	-16.61
600666	奥瑞德	81.48	600280	中央商场	-14.73
600754	锦江股份	80.64	601877	正泰电器	-14.09
600697	欧亚集团	79.01	600312	平高电气	-11.68

上证综指

代码	简称	涨幅%	代码	简称	跌幅%
603398	邦宝益智	561.56	601003	柳钢股份	-42.40
603936	博敏电子	536.23	600634	中技控股	-42.30
603999	读者传媒	501.84	600555	九龙山	-40.30
603696	安记食品	448.22	600652	游久游戏	-40.22
603800	道森股份	392.51	600058	五矿发展	-39.16
600053	九鼎投资	346.80	600277	亿利洁能	-37.79
600734	实达集团	321.49	600097	开创国际	-35.05
603996	中新科技	180.80	600110	中科英华	-29.72
603866	桃李面包	180.60	600428	中远航运	-28.00
600556	慧球科技	169.35	600072	钢构工程	-24.70

二、本季度十大成交成分股

上证180指数

代码	简称	成交金额(亿元)	代码	简称	成交股数(亿股)
600030	中信证券	3558.47	600030	中信证券	190.46
601989	中国重工	2073.57	601989	中国重工	189.12
601318	中国平安	1987.17	601988	中国银行	184.98
601766	中国中车	1627.66	601288	农业银行	180.84
600503	华丽家族	1496.64	601668	中国建筑	159.67
601985	中国核电	1402.99	601985	中国核电	133.54
600837	海通证券	1339.33	601099	太平洋	116.11
600570	恒生电子	1307.65	601766	中国中车	114.98
601377	兴业证券	1281.20	600503	华丽家族	113.58
601166	兴业银行	1247.70	600028	中国石化	111.87

上证 50 指数

代码	简称	成交金额 (亿元)	代码	简称	成交股数 (亿股)
600030	中信证券	3558.47	600030	中信证券	190.46
601989	中国重工	2073.57	601989	中国重工	189.12
601318	中国平安	1987.17	601988	中国银行	184.98
601766	中国中车	1627.66	601288	农业银行	180.84
601985	中国核电	1402.99	601668	中国建筑	159.67
600837	海通证券	1339.33	601985	中国核电	133.54
601166	兴业银行	1247.70	601766	中国中车	114.98
601211	国泰君安	1206.09	600028	中国石化	111.87
601901	方正证券	1097.04	601398	工商银行	111.86
601668	中国建筑	1060.29	601901	方正证券	111.43

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)
600446	金证股份	1244.84	600635	大众公用	88.29
600635	大众公用	861.47	600307	酒钢宏兴	87.57
600650	锦江投资	760.38	600601	方正科技	64.42
600783	鲁信创投	695.44	600210	紫江企业	61.93
600611	大众交通	661.08	601880	大连港	50.81
600634	中技控股	649.39	601636	旗滨集团	48.95
600704	物产中大	641.40	600567	山鹰纸业	48.03
600410	华胜天成	628.09	600017	日照港	47.19
600405	动力源	551.66	600255	鑫科材料	45.68
600571	信雅达	544.82	600711	盛屯矿业	45.23

上证综指

代码	简称	成交金额 (亿元)	代码	简称	成交股数 (亿股)
600030	中信证券	3558.47	600030	中信证券	190.46
601989	中国重工	2073.57	601989	中国重工	189.12
601318	中国平安	1987.17	601988	中国银行	184.98
601766	中国中车	1627.66	601288	农业银行	180.84
600503	华丽家族	1496.64	600868	梅雁吉祥	174.39
601985	中国核电	1402.99	601668	中国建筑	159.67
600868	梅雁吉祥	1345.28	601985	中国核电	133.54
600837	海通证券	1339.33	601099	太平洋	116.11
600570	恒生电子	1307.65	601766	中国中车	114.98
601377	兴业证券	1281.20	600503	华丽家族	113.58

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	13,520.49	能源	65.23	11.06	58.81	7.71
601398	工商银行	12,348.24	金融地产	16.80	10.10	14.49	7.04
601288	农业银行	9,497.99	金融地产	12.92	7.77	11.15	5.41
601988	中国银行	8,451.70	金融地产	11.50	6.91	9.92	4.82
601628	中国人寿	5,895.14	金融地产	8.02	4.82	6.92	3.36
600028	中国石化	4,739.67	能源	22.87	3.88	20.62	2.70
601318	中国平安	3,899.76	金融地产	5.31	3.19	4.58	2.22
600036	招商银行	3,711.15	金融地产	5.05	3.04	4.35	2.12
600000	浦发银行	3,407.99	金融地产	4.64	2.79	4.00	1.94
601166	兴业银行	3,252.23	金融地产	4.42	2.66	3.82	1.85

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%
601238	广汽集团	952.84	汽车与汽车零部件	33.37	1.91
601888	中国国旅	579.01	消费者服务	47.99	1.16
601158	重庆水务	447.84	公用事业	12.84	0.90
601098	中南传媒	429.24	媒体	37.15	0.86
600160	巨化股份	425.02	原材料	5.98	0.85
600446	金证股份	408.53	软件与服务	23.74	0.82
600098	广州发展	344.32	公用事业	9.87	0.69
600642	申能股份	343.68	公用事业	9.86	0.69
600350	山东高速	342.07	运输	7.56	0.69
600009	上海机场	341.30	运输	7.54	0.68

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	13,520.49	13,520.49	能源
601398	工商银行	12,348.24	12,348.24	金融地产
601288	农业银行	9,497.99	9,497.99	金融地产
601988	中国银行	8,451.70	8,451.70	金融地产
601628	中国人寿	5,895.14	5,895.14	金融地产
600028	中国石化	4,739.67	4,739.67	能源
601318	中国平安	3,899.76	3,899.76	金融地产
600036	招商银行	3,711.15	3,711.15	金融地产
600000	浦发银行	3,407.99	3,407.99	金融地产
601166	兴业银行	3,252.23	2,761.86	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				
50~100 亿元	2	0.55	177.50	0.67
100~500 亿	88	18.97	27966.53	29.46
500~1000 亿	45	80.36	30173.82	79.24
1000~5000 亿	40	97.56	77213.85	97.49
5000 亿元以上	5	100	49713.56	100

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	2	0.43	967.53	1.02
500~1000 亿	7	12.50	5373.92	14.11
1000~5000 亿	36	87.80	71776.48	90.63
5000 亿元以上	5	100	49713.56	100

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				
30~50 亿	4	3.01	182.59	3.32
50~100 亿	118	32.33	9166.37	34.83
100~200 亿	172	60.35	24538.58	61.01
200~500 亿	81	45.25	22237.82	40.65
500 亿元以上	5	4.90	3684.53	2.21

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	51	933.92	884.57
30~50 亿	138	5694.31	5218.52
50~100 亿	368	26514.95	21993.37
100~200 亿	286	40352.13	31849.07
200~500 亿	179	54704.51	45275.13
500 亿元以上	102	166994.37	148907.17

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 (2015. 12. 31)	季度涨跌%		
上证 180 系列							
000010	上证 180	8484.93	2015-11-09	7211.11	2015-10-08	7995.77	13.72
000016	上证 50	2592.19	2015-11-09	2189.99	2015-10-08	2420.80	12.80
000018	180 金融	5205.99	2015-12-23	4247.77	2015-10-08	4911.13	17.34
000021	180 治理	994.38	2015-11-09	841.40	2015-10-08	923.47	12.21
000025	180 基建	2360.26	2015-11-09	2002.34	2015-12-14	2035.05	0.34
000026	180 资源	2578.12	2015-11-10	2230.70	2015-10-09	2343.17	8.27
000027	180 运输	1337.43	2015-11-09	1169.94	2015-11-30	1182.49	0.19
000043	超大盘	2269.05	2015-11-09	1979.38	2015-10-08	2110.63	9.04
000044	上证中盘	4061.88	2015-12-23	3448.78	2015-10-08	3864.29	15.23
000050	50 等权	2683.12	2015-11-09	2259.94	2015-10-08	2474.25	12.33
000054	上证海外	1256.69	2015-11-09	1070.89	2015-10-08	1158.78	10.55
上证 180 风格指数							
000028	180 成长	3056.27	2015-12-23	2497.06	2015-10-08	2880.08	17.92
000029	180 价值	3769.24	2015-11-09	3270.54	2015-10-08	3570.16	10.92
000030	180R 成长	2130.34	2015-12-23	1752.26	2015-10-09	2006.63	18.21
000031	180R 价值	3038.58	2015-11-09	2637.53	2015-10-08	2856.95	10.49
上证规模指数							
000009	上证 380	6994.87	2015-11-26	5611.97	2015-10-08	6712.76	22.72
000045	上证小盘	6001.35	2015-11-26	4852.87	2015-10-08	5696.34	20.34
000046	上证中小	4896.83	2015-11-17	4080.98	2015-10-08	4679.44	17.75
000047	上证全指	3529.31	2015-11-09	3003.58	2015-10-08	3374.51	15.52
上证全指风格指数							
000057	全指成长	3588.63	2015-12-23	2953.55	2015-10-08	3406.19	18.18
000058	全指价值	3807.08	2015-11-09	3308.12	2015-10-08	3619.12	11.64
000059	全 R 成长	3261.26	2015-12-23	2670.15	2015-10-08	3105.51	19.94
000060	全 R 价值	3759.53	2015-11-09	3257.38	2015-10-08	3569.34	12.26
上证行业指数							
000032	上证能源	1792.53	2015-11-11	1555.93	2015-11-30	1626.12	6.94
000033	上证材料	2048.07	2015-11-26	1751.79	2015-10-08	1934.10	13.39
000034	上证工业	3099.50	2015-11-09	2646.26	2015-11-30	2699.86	2.25
000035	上证可选	3434.58	2015-12-23	2851.35	2015-10-08	3295.83	19.05
000036	上证消费	6594.26	2015-12-22	5681.64	2015-10-09	6260.98	13.72
000037	上证医药	6930.69	2015-12-23	5620.84	2015-10-08	6719.12	24.72
000038	上证金融	4913.59	2015-12-23	4005.30	2015-10-08	4634.81	17.48
000039	上证信息	5468.84	2015-11-26	3973.14	2015-10-08	5120.05	31.86
000040	上证电信	3460.18	2015-12-30	2488.25	2015-10-08	3329.50	38.09
000041	上证公用	2947.88	2015-11-09	2621.25	2015-10-08	2707.90	5.58

代码	简称	最高 (日期)	最低 (日期)	收盘 (2015.09.30)	季度涨跌%
上证行业策略指数					
000070	能源等权	3033.99	2593.22	2831.39	12.65
000071	材料等权	3315.70	2715.38	3133.33	18.36
000072	工业等权	4020.96	3476.52	3590.91	4.38
000073	可选等权	4150.41	3363.18	3958.82	21.13
000074	消费等权	6340.81	5375.85	6145.74	17.13
000075	医药等权	9733.10	7687.56	9373.32	27.51
000076	金融等权	5305.79	4249.65	4989.84	19.47
000077	信息等权	7298.82	5172.12	6862.60	35.79
000078	电信等权	3433.13	2540.31	3253.56	31.64
000079	公用等权	3460.12	2963.87	3218.51	11.31
上证央企、民企、国企主题指数					
000042	上证央企	1745.19	1484.85	1566.71	7.89
000049	上证民企	1824.71	1531.05	1765.80	18.55
000055	上证地企	1160.25	957.86	1095.08	16.77
000056	上证国企	1099.85	932.96	1016.59	11.44
上证其他主题指数					
000015	红利指数	2915.63	2494.22	2784.95	14.32
000048	责任指数	1349.84	1143.03	1292.31	15.41
000062	上证沪企	2759.90	2318.46	2588.88	13.98
000063	上证周期	3172.79	2634.86	2994.20	15.67
000064	非周期	3003.30	2595.74	2785.54	10.74
000065	上证龙头	3593.36	3006.14	3421.14	17.45
000066	上证商品	1936.80	1653.76	1823.48	13.67
000067	上证新兴	8339.46	6947.60	7913.13	18.44
000068	上证资源	2138.43	1825.39	1991.01	12.82
000069	消费 80	4209.39	3565.75	4044.78	17.45
上证综合类指数					
000001	上证指数	3684.57	3133.13	3539.18	15.93
000002	A 股指数	3856.74	3281.56	3704.30	15.85
000003	B 股指数	453.30	316.25	426.41	37.68
000004	工业指数	2944.95	2494.31	2817.19	16.06
000005	商业指数	5779.38	4272.20	5649.90	35.50
000006	地产指数	7065.62	5695.54	6567.51	18.12
000007	公用指数	7713.84	6470.65	6990.85	10.83
000008	综合指数	3211.52	2686.09	3046.37	15.72
000017	新综指	3110.31	2646.62	2987.17	15.84
000020	中型综指	1904.63	1395.37	1857.58	36.08
000090	上证流通	1349.37	1119.57	1296.98	19.02
上证行业指数固定收益指数					
000012	国债指数	154.67	151.72	154.54	1.93
000013	企债指数	197.18	193.54	197.12	1.96
000022	沪公司债	171.36	168.82	171.30	1.55
000023	沪分离债				
000061	沪企债 30	140.37	138.75	140.13	0.94
上证基金类指数					
000011	基金指数	5984.72	5502.79	5904.92	9.29

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	博时上证 50 交易型开放式指数证券投资基金	上海证券交易所	510710.OF	2.04
上证可质押城投债指数	海富通上证可质押城投债交易型开放式指数证券投资基金	上海证券交易所	511220.OF	62.60
上证 380 指数	万家上证 380 交易型开放式指数证券投资基金	上海证券交易所	510680.OF	0.06
上证企债 30 指数	上证企债 30 交易型开放式指数证券投资基金	上海证券交易所	511210.OF	0.94
上证 180 高贝塔指数	上证 180 高贝塔交易型开放式指数证券投资基金	上海证券交易所	510450.OF	0.09
上证金融地产行业指数	上证金融地产交易型开放式指数发起式证券投资基金	上海证券交易所	510650.OF	1.29
上证能源行业指数	上证能源交易型开放式指数发起式证券投资基金	上海证券交易所	510610.OF	0.38
上证医药卫生行业指数	上证医药卫生交易型开放式指数发起式证券投资基金	上海证券交易所	510660.OF	1.95
上证原材料行业指数	上证原材料交易型开放式指数发起式证券投资基金	上海证券交易所	510620.OF	0.38
上证主要消费行业指数	上证主要消费交易型开放式指数发起式证券投资基金	上海证券交易所	510630.OF	3.04
上证 5 年期国债指数	上证 5 年期国债交易型开放式指数证券投资基金	上海证券交易所	511010.OF	11.13
上证 50 等权重指数	上证 50 等权重交易型开放式指数证券投资基金	上海证券交易所	510430.OF	1.10
上证 180 等权重指数	上证 180 等权重交易型开放式指数基金	上海证券交易所	510420.OF	2.37
上证自然资源指数	上证自然资源交易型开放式指数证券投资基金	上海证券交易所	510410.OF	0.83
上证 380 指数	上证 380 交易型开放式指数证券投资基金	上海证券交易所	510290.OF	3.06
上证 180 成长指数	上证 180 成长交易型开放式指数证券投资基金	上海证券交易所	510280.OF	0.78
上证国有企业 100 指数	上证国有企业 100 交易型开放式指数基金	上海证券交易所	510270.OF	0.29
上证非周期行业 100 指数	上证非周期行业 100 交易型开放式指数基金	上海证券交易所	510120.OF	0.41
上证新兴产业指数	上证新兴产业交易型开放式指数证券投资基金	上海证券交易所	510260.OF	1.07
上证 180 金融股指数	上证 180 金融交易型开放式指数证券投资基金	上海证券交易所	510230.OF	36.01
上证综合指数	富国上证综指交易型开放式指数证券投资基金	上海证券交易所	510210.OF	1.72
上证中小盘指数	上证中小盘交易型开放式指数证券投资基金	上海证券交易所	510220.OF	0.34
上证消费 80 指数	上证消费 80 交易型开放式指数证券投资基金	上海证券交易所	510150.OF	1.79
上证大宗商品股票指数	上证大宗商品股票交易型开放式指数基金	上海证券交易所	510170.OF	1.62
上证龙头企业指数	上证龙头企业交易型开放式指数证券投资基金	上海证券交易所	510190.OF	1.46
上证周期行业 50 指数	上证周期行业 50 交易型开放式指数基金	上海证券交易所	510110.OF	0.57
上证民营企业 50 指数	上证民营企业 50 交易型指数证券投资基金	上海证券交易所	510070.OF	1.00
上证社会责任指数	上证社会责任交易型开放式指数证券投资基金	上海证券交易所	510090.OF	1.22
上证 180 价值指数	上证 180 价值交易型开放式指数证券投资基金	上海证券交易所	510030.OF	1.79
上证中盘指数	易方达上证中盘交易型指数证券投资基金	上海证券交易所	510130.OF	3.39
上证超级大盘指数	上证超级大盘交易型开放式指数证券投资基金	上海证券交易所	510020.OF	2.59
上证 180 公司治理指数	上证 180 公司治理交易型指数证券投资基金	上海证券交易所	510010.OF	6.73
上证央企 50 指数	上证中央企业 50 开放式指数证券投资基金	上海证券交易所	510060.OF	2.99
上证红利指数	上证红利交易型开放式指数证券投资基金	上海证券交易所	510880.OF	6.44
上证 180 指数	上证 180 交易型开放式指数证券投资基金	上海证券交易所	510180.OF	192.25
上证 50 指数	上证 50 交易型开放式指数证券投资基金	上海证券交易所	510050.OF	301.51
上证 50 指数	中银国际·德国商业银行—上证 50 A 股指数 UCITS ETF	中欧国际交易所	B0C1.GR	0.14
上证 50 指数	中银保诚标智上证 50ETF	香港交易所	3024.HK	0.99
上证 50 指数	中银保诚标智上证 50ETF	台湾证券交易所	008201.TW	/
上证 50 指数	元大宝来上证 50ETF	台湾证券交易所	006206:TT	8.93
上证 50 指数	野村上证 50ETF	大阪证券交易所	1309.0	3.87
上证 50 指数	大华上证 50ETF	新加坡交易所	USSE50.SP	1.55
上证 180 指数	富邦上证 180ETF	台湾证券交易所	006205.TW	27.27
上证 180 两倍杠杆指数	富邦上证 180 单日正向两倍基金	台湾证券交易所	00633L:TT	45.72
上证 180 反向指数	富邦上证 180 单日反向一倍基金	台湾证券交易所	00634R:TT	3.96
指数基金				
上证 50 指数	长盛上证 50 指数分级证券投资基金	上海证券交易所	502040.OF	0.41
上证 50 指数	天弘上证 50 指数型发起式证券投资基金	上海证券交易所	001548.OF	0.13
上证 50 指数	国金上证 50 指数分级证券投资基金	上海证券交易所	502020.OF	0.36
上证 50 指数	易方达上证 50 指数分级证券投资基金	上海证券交易所	502048.OF	9.14
上证 380 指数	中邮上证 380 指数增强型证券投资基金	上海证券交易所	590007.OF	0.83
上证 50 指数	中海上证 50 指数增强型证券投资基金	上海证券交易所	399001.OF	1.60
上证综合指数	汇添富上证综合指数证券投资基金	上海证券交易所	470007.OF	16.08
上证 50 指数	易方达 50 指数证券投资基金	上海证券交易所	110003.OF	87.76
上证 180 指数	万家 180 指数证券投资基金	上海证券交易所	519180.OF	18.87

指标定义

1. 流通市值覆盖率

与全市场比较，考察指数样本股流通市值所占比例大小，该值越大表明市场代表性越强。

$$\text{算法：流通市值覆盖率} = \frac{MV_I}{MV_M}$$

其中， MV_I - 指数 2010-12-31 的流通市值；

MV_M - 如果是上证 50 指数、上证 180 指数，上证 380 指数，是上证 A 股 2010-12-31 的流通市值；

如果是上证综指，是上证综指 2010-12-31 的流通市值。

2. 总市值覆盖率

与全市场比较，考察指数样本股总市值所占比例大小，该值越大表明市场代表性越强。

$$\text{算法：总市值覆盖率} = \frac{TMV_I}{TMV_M}$$

其中， TMV_I - 指数 2010-12-31 的总市值；

TMV_M - 如果是上证 50 指数、上证 180 指数，上证 380 指数，是上证 A 股 2010-12-31 的总市值；

如果是上证综指，是上证综指 2010-12-31 的总市值。

3. 样本股日均成交金额

考察指数样本股总成交金额，反应考察期间市场资金向指数流向的情况，该值越大说明市场代表性越好。

$$\text{算法：样本股日均成交金额} = \text{mean} \left(\frac{\text{每日指数的成交金额}}{\text{每日样本股个数}} \right)$$

4. 换手率

考察指数的成交活跃程度，反映指数流动性的高低。

$$\text{算法：} TO = \frac{TTV}{TMN} = \frac{\sum TV_i}{\sum MN_i}$$

其中， TO - 换手率；

TTV - 总成交量；

TMN - 流通股本；

TV_i - 指数中第 i 只股票的成交量；

MN_i - 指数中第 i 只股票的流通股本

5. 税后利润

$$\text{算法：} PNP_I = \sum (Jlr_i \times TN_i / PN_i)$$

其中， PNP_I - 指数的税后利润；

Jlr_i - 指数中第 i 只股票的净利润；

TN_i - 指数中第 i 只股票的 A 股股本；

PN_i - 指数中第 i 只股票的公司股本（含 A、H 等股本）。

6. 每股收益

$$\text{算法：} PNP_I = \frac{\sum (Jlr_i \times TN_i / PN_i)}{\sum TN_i}$$

其中， PNP_I - 指数的每股收益；

Jlr_i - 指数中第 i 只股票的净利润；

TN_i - 指数中第 i 只股票的 A 股股本；

PN_i - 指数中第 i 只股票的公司股本（含 A、H 等股本）。

7. 股东权益

$$\text{算法：} PNA_I = \sum (jzc_i \times TN_i / PN_i)$$

其中， PNA_I - 指数的股东权益；

jzc_i - 指数中第 i 只股票的净资产；

TN_i - 指数中第 i 只股票的 A 股股本；

PN_i - 指数中第 i 只股票的公司股本（含 A、H 等股本）。

8. 每股净资产

$$\text{算法：} PNA_I = \frac{\sum (jzc_i \times TN_i / PN_i)}{\sum TN_i}$$

其中， PNA_I - 指数的每股净资产；

Jzc_i - 指数中第 i 只股票的净资产；

TN_i - 指数中第 i 只股票的 A 股股本；

PN_i - 指数中第 i 只股票的公司股本 (含 A、H 等股本)。

9. 总资产收益率

从总资产的角度考察指数样本股的收益情况, 反映指数样本股与实体经济的关系。

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

其中, ROTA - 总资产收益率;

TNP - 净利润 (含少数股东损益);

TA - 资产总额;

NP_i - 指数中第 i 只股票的净利润;

TA_i - 指数中第 i 只股票的总资产。

TN_i - 指数中第 i 只股票的 A 股股本;

PN_i - 指数中第 i 只股票的公司股本 (含 A、H 等股本)。

10. 净资产收益率

考察指数样本股的股权资产的收益情况, 反映指数样本股与实体经济的关系。

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

其中, ROE - 净资产收益率

TNP - 净利润总额;

TNA - 净资产总额;

NP_i - 指数中第 i 只股票的净利润;

NA_i - 指数中第 i 只股票的净资产。

TN_i - 指数中第 i 只股票的 A 股股本;

PN_i - 指数中第 i 只股票的公司股本 (含 A、H 等股本)。

11. 股东权益比率

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

其中, ROR - 股东权益比率;

TPR - 股东权益 (含少数股东权益);

TA - 资产总额;

PR_i - 指数中第 i 只股票的股东权益;

TA_i - 指数中第 i 只股票的总资产。

TN_i - 指数中第 i 只股票的 A 股股本;

PN_i - 指数中第 i 只股票的公司股本 (含 A、H 等股本)。

12. 资产负债比率

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

其中, ROD - 资产负债比率;

PR_i - 指数中第 i 只股票的股东权益 (含少数股东权益);

TA_i - 指数中第 i 只股票的总资产。

TN_i - 指数中第 i 只股票的 A 股股本;

PN_i - 指数中第 i 只股票的公司股本 (含 A、H 等股本)。

13. 季度末市值规模分布

上证 180、50、380 指数成分股的市值规模分布:

流通市值占市场比例 (%) : 跟上海 A 股股票去比;

上证综合指数成份股的市值规模分布:

流通市值占市场比例 (%) : 跟上海 A、B 股股票去比