

上证指数季报

2016年01-03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（2016.01-2016.03）	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（2016年3月31日）和四季度涨跌幅

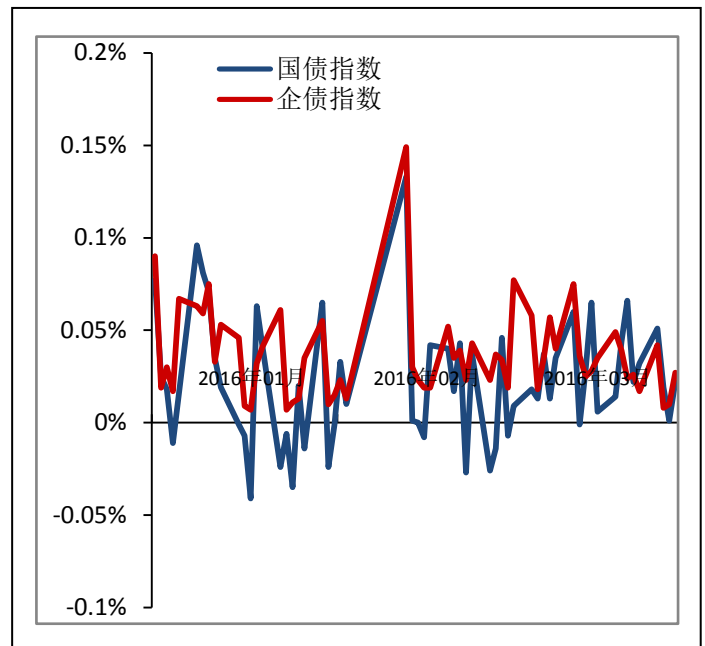
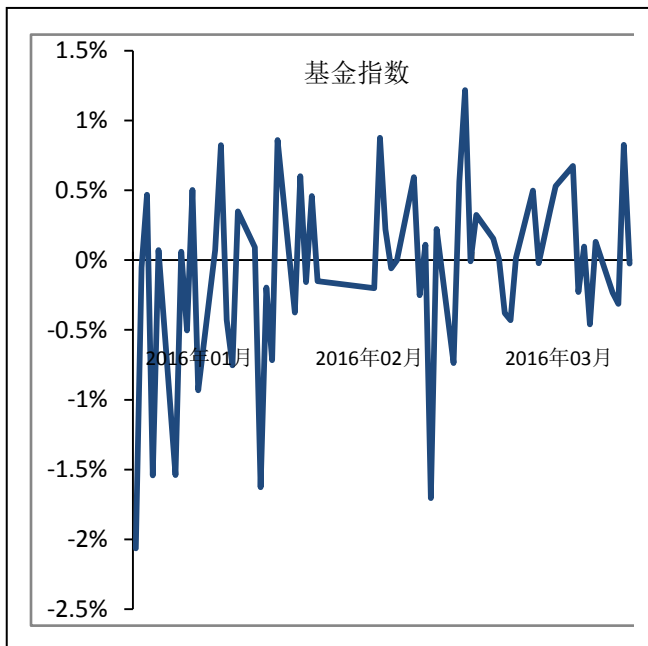
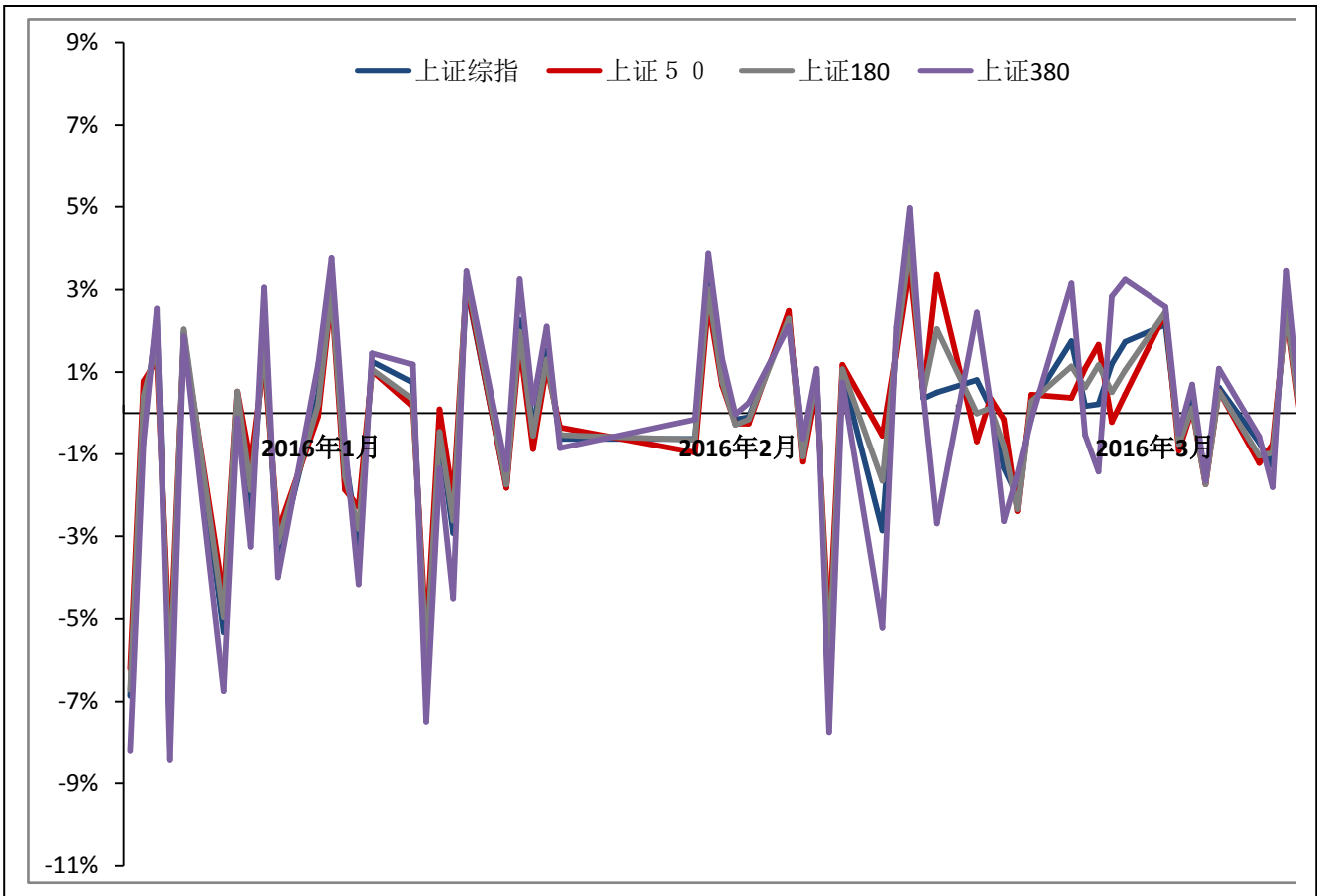
上证180指数	6921.88	-13.43%	上证企债指数	201.41	2.18%
上证50指数	2156.54	-10.92%	上证国债指数	156.63	1.35%
上证380指数	5422.17	-19.23%	上证基金指数	5655.37	-4.23%
上证综指指数	3003.92	-15.12%			

本季度180指数与上证综指的日收益率相关系数为98.58%，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69%，总市值占64%，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92.27%，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0.65元、0.72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11.22倍、9.49倍和35.09倍，而上年同期上证180指数、上证50指数和上证380指数的市盈率则分别为13.66倍、11.66倍和39.24倍。

本季度上证企债指数涨幅2.177%，在沪市A股指数体系中涨幅居前。本季度上证电信指数跌幅-22.035%，在沪市A股指数体系中跌幅居前。

上证指数季度走势 (2016.01-2016.03)

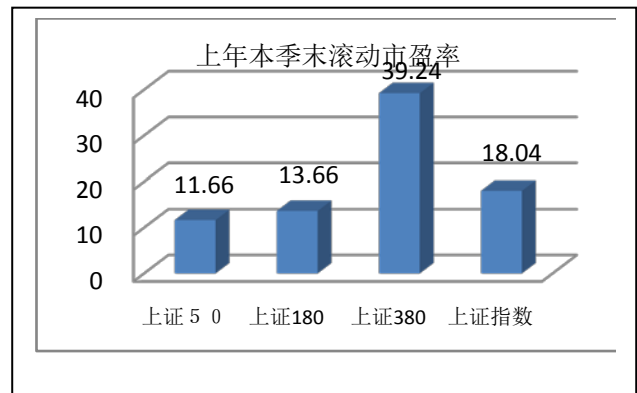
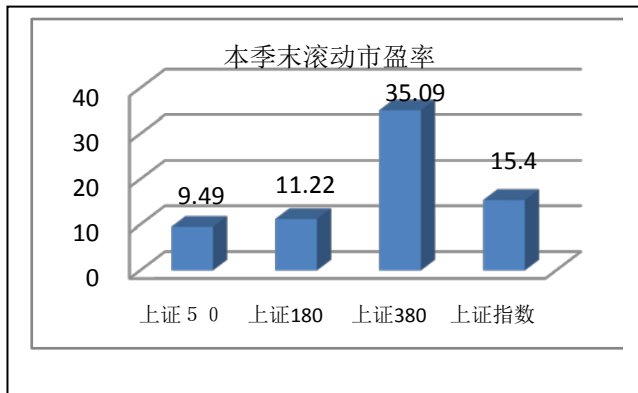


指数基本资料

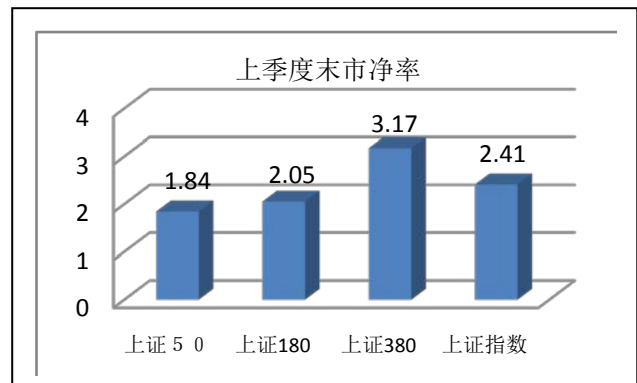
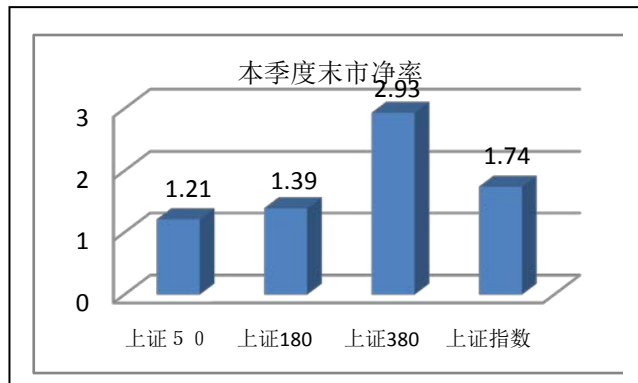
一、上证指数收益率和波动率

	累计收益%					日收益标准差%				
	01月	02月	03月	季度	上年本季	01月	02月	03月	季度	上年本季
上证50	-18.50	-1.44	10.90	-10.92	6.71	2.78	1.85	1.48	2.19	2.18
上证180	-21.10	-1.63	11.55	-13.43	11.54	3.06	2.04	1.43	2.36	1.93
上证380	-28.23	-1.66	14.44	-19.23	31.42	3.93	2.83	2.10	3.16	1.48
上证指数	-22.65	-1.81	11.75	-15.12	15.87	3.24	2.24	1.44	2.51	1.84

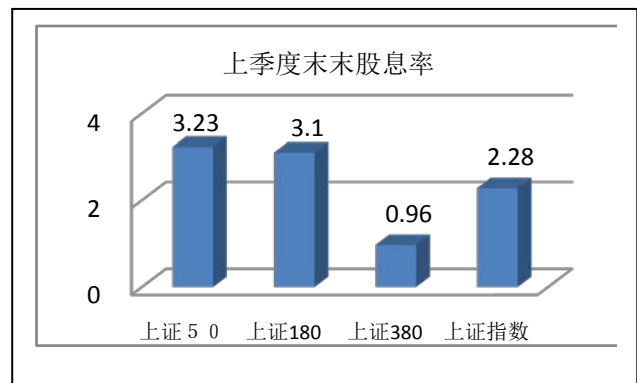
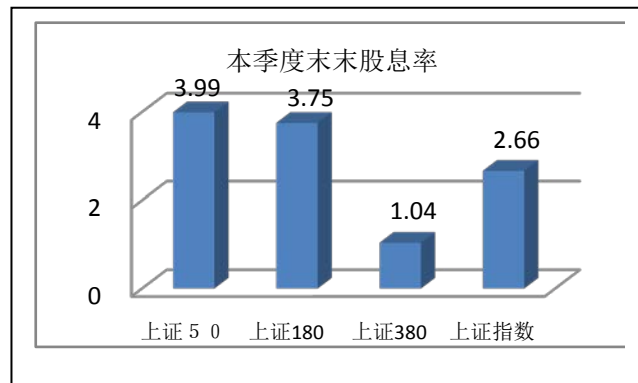
二、上证指数市盈率



三、上证指数市净率



四、上证指数股息率



五、上证指数市场基本指标

	上证 50	上证 180	上证 380	上证综指
指数总市值 (万亿元)	11.48	16.26	4.93	25.41
指数总市值覆盖率%	45	64	19	100
指数流通市值 (万亿元)	10.92	15.20	3.96	22.04
指数流通市值覆盖率%	50	69	18	100
样本股日均成交额 (亿元)	7.01	4.51	1.68	1.91
换手率%	13.22	23.80	91.63	44.06
指数日收益相关系数	98.54	100	92.27	98.58

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)	12080.85	14347.84	1281.26	15717.27
股东权益 (亿元)	95154.10	116995.73	16853.10	145183.61
每股收益 (元)	0.72	0.65	0.30	0.52
每股净资产 (元)	5.70	5.30	3.91	4.76
净资产收益率%	12.70	12.26	7.60	10.83
股东权益比率%	10.12	11.42	38.29	13.08
资产负债比率%	89.88	88.58	61.71	86.92
资产报酬率%	1.28	1.40	2.91	1.42

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	19189.46	80.69	17.57
原材料	3	1.63	1422.91	8.23	1.30
工业	11	4.09	12685.32	31.02	11.61
可选消费	2	1.05	2830.12	14.09	2.59
主要消费	3	3.53	4675.47	42.88	4.28
金融地产	25	22.32	66592.40	83.52	60.96
电信业务	1	6.25	930.53	34.20	0.85
公用事业	2	3.70	905.62	10.30	0.83

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	20,946.24	88.08	13.78
原材料	18	9.78	6,673.73	38.60	4.39
工业	39	14.50	23,231.03	56.81	15.28
可选消费	19	10	7,768.68	38.67	5.11
主要消费	11	12.94	6,482.75	59.45	4.26
医药卫生	8	12.90	2,924.09	41.10	1.92
金融地产	58	51.79	75,808.30	95.08	49.87
信息技术	7	10.29	2420.42	30.45	1.59
电信业务	2	12.50	1,229.25	45.18	0.81
公用事业	9	16.67	4,535.70	51.60	2.98

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	1,542.39	6.49	3.90
原材料	60	32.61	5,540.18	32.04	14.00
资本品	78	40.00	7,335.13	25.89	18.53
商业服务与商业用品	9	45.00	708.14	57.50	1.79
运输	27	50.00	3,777.52	33.35	9.54
汽车与汽车零部件	16	34.78	2,444.26	32.36	6.18
耐用消费品与服装	16	25.81	1,523.92	31.26	3.85
消费者服务	6	33.33	947.44	68.63	2.39
媒体	6	27.27	899.86	28.64	2.27
零售业	19	45.24	1,622.54	51.72	4.10
食品与主要用品零售	4	23.53	272.71	11.43	0.69
食品、饮料与烟草	20	31.25	1,606.27	19.65	4.06
家庭与个人用品	1	25.00	49.05	14.30	0.12
医疗保健设备与服务	1	20.00	95.40	31.54	0.24
制药、生物技术和生命科学	27	47.37	2,876.97	42.23	7.27
房地产	16	21.33	1311.48	13.96	3.31
软件与服务	9	42.86	1205.65	40.40	3.05
技术硬件与设备	14	41.18	1343.70	38.06	3.39
半导体产品与设备	7	53.85	892.70	62.22	2.26
通信设备	6	40.00	819.58	45.78	2.07
公用事业	24	44.44	2,764.44	31.45	6.98

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	25,503.76	23,849.23
原材料	193	21,083.26	17,437.07
工业	284	47,906.86	41,222.56
可选消费	202	25,227.47	20,314.11
主要消费	88	13,604.52	10,945.12
医药卫生	63	8,323.35	7,121.56
金融地产	117	86,800.06	79,910.76
信息技术	70	9,957.72	7,995.57
电信业务	18	3,109.23	2,752.15
公用事业	56	12565.29	8814.47

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%
600490	鹏欣资源	31.01	600718	东软集团	-39.68
600547	山东黄金	25.19	600645	中源协和	-39.49
600519	贵州茅台	13.50	600588	用友网络	-34.39
600489	中金黄金	7.96	600649	城投控股	-33.85
600219	南山铝业	5.47	600252	中恒集团	-32.97
600688	上海石化	5.25	600256	广汇能源	-32.68
			601919	中国远洋	-32.48
			600085	同仁堂	-32.37
			601216	君正集团	-32.31
			600839	四川长虹	-31.26

上证 50 指数

代码	简称	涨幅%	代码	简称	跌幅%
600519	贵州茅台	13.50	600050	中国联通	-28.96
			600150	中国船舶	-27.88
			601390	中国中铁	-26.28
			600637	东方明珠	-24.39
			601989	中国重工	-23.51
			601336	新华保险	-22.29
			600795	国电电力	-21.63
			601766	中国中车	-20.31
			601006	大秦铁路	-20.30
			601669	中国电建	-19.55

上证380指数

代码	简称	涨幅%	代码	简称	跌幅%
600116	三峡水利	59.59	600160	巨化股份	-48.70
600988	赤峰黄金	49.18	600978	宜华木业	-47.25
600880	博瑞传播	48.80	600967	北方创业	-41.18
600623	双钱股份	32.30	600416	湘电股份	-38.35
600990	四创电子	26.68	600410	华胜天成	-37.65
600298	安琪酵母	24.52	600667	太极实业	-37.31
600864	哈投股份	17.83	600565	迪马股份	-36.90
600395	盘江股份	12.55	600783	鲁信创投	-36.88
600188	兖州煤业	12.38	600172	黄河旋风	-36.78
601880	大连港	12.25	603883	老百姓	-35.86

上证综指

代码	简称	涨幅%	代码	简称	跌幅%
601020	华钰矿业	262.81	600678	四川金顶	-49.98
603520	司太立	224.69	603800	道森股份	-49.23
603299	井神股份	216.57	600160	巨化股份	-48.70
601900	南方传媒	211.42	600978	宜华木业	-47.25
603027	千禾味业	201.41	600589	广东榕泰	-45.98
603861	白云电器	180.59	600306	商业城	-44.74
603377	东方时尚	143.90	600734	实达集团	-43.38
603608	天创时尚	134.29	600139	西部资源	-42.65
603919	金徽酒	133.18	600967	北方创业	-41.18
603778	乾景园林	92.72	600892	宝诚股份	-41.04

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	1806.76	601989	中国重工	124.68
601318	中国平安	1089.07	600030	中信证券	111.91
600570	恒生电子	974.29	601988	中国银行	107.38
601989	中国重工	883.53	601288	农业银行	102.42
601198	东兴证券	876.42	601899	紫金矿业	97.38
600837	海通证券	696.65	601668	中国建筑	92.38
601166	兴业银行	672.39	600028	中国石化	81.51
600547	山东黄金	624.68	601377	兴业证券	73.74
600048	保利地产	622.07	601398	工商银行	72.88
601377	兴业证券	610.00	601099	太平洋	70.45

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	1806.76	601989	中国重工	124.68
601318	中国平安	1089.07	600030	中信证券	111.91
601989	中国重工	883.53	601988	中国银行	107.38
600837	海通证券	696.65	601288	农业银行	102.42
601166	兴业银行	672.39	601668	中国建筑	92.38
600048	保利地产	622.07	600028	中国石化	81.51
601688	华泰证券	540.21	601398	工商银行	72.88
600000	浦发银行	539.96	601328	交通银行	69.48
600109	国金证券	536.89	600050	中国联通	67.17
601766	中国中车	531.41	601818	光大银行	66.14

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	627.68	600546	山煤国际	52.14
600756	浪潮软件	538.51	600307	酒钢宏兴	52.10
600116	三峡水利	514.28	600425	青松建化	45.49
600651	飞乐音响	431.14	600565	迪马股份	43.06
600528	中铁二局	425.26	600123	兰花科创	37.61
600988	赤峰黄金	376.95	601699	潞安环能	34.94
600650	锦江投资	360.95	600528	中铁二局	30.98
600391	成发科技	344.28	600651	飞乐音响	30.71
600662	强生控股	340.16	600399	抚顺特钢	30.53
600565	迪马股份	325.78	600282	南钢股份	29.73

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	1806.76	601989	中国重工	124.68
601318	中国平安	1089.07	600030	中信证券	111.91
600570	恒生电子	974.29	601988	中国银行	107.38
601989	中国重工	883.53	601288	农业银行	102.42
601198	东兴证券	876.42	601899	紫金矿业	97.38
600837	海通证券	696.65	601668	中国建筑	92.38
601166	兴业银行	672.39	600868	梅雁吉祥	92.31
600446	金证股份	627.68	600028	中国石化	81.51
600547	山东黄金	624.68	601377	兴业证券	73.74
600048	保利地产	622.07	601398	工商银行	72.88

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	12,322.27	能源	64.21	11.15	58.51	7.95
601398	工商银行	11,566.36	金融地产	17.21	10.46	15.01	7.46
601288	农业银行	9,409.77	金融地产	14.00	8.51	12.21	6.07
601988	中国银行	7,166.03	金融地产	10.66	6.48	9.30	4.62
601628	中国人寿	4,968.49	金融地产	7.39	4.49	6.45	3.21
600028	中国石化	4,548.55	能源	23.70	4.11	21.60	2.93
600000	浦发银行	3,523.78	金融地产	5.24	3.19	4.57	2.27
601318	中国平安	3,445.87	金融地产	5.13	3.12	4.47	2.22
600036	招商银行	3,319.20	金融地产	4.94	3.00	4.31	2.14
600519	贵州茅台	3,110.85	主要消费	66.47	2.81	47.56	2.01

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	870.52	汽车与汽车零部件	34.83	2.11
601888	中国国旅	445.65	消费者服务	46.06	1.08
601158	重庆水务	372.48	公用事业	13.08	0.90
600009	上海机场	347.89	运输	9.00	0.84
601098	中南传媒	340.52	媒体	37.84	0.83
600377	宁沪高速	319.00	运输	8.26	0.77
600188	兖州煤业	314.35	能源	20.36	0.76
600446	金证股份	309.04	软件与服务	24.50	0.75
600642	申能股份	276.31	公用事业	9.71	0.67
600350	山东高速	270.87	运输	7.01	0.66

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	12,322.27	12,322.27	能源
601398	工商银行	11,566.36	11,566.36	金融地产
601288	农业银行	9,409.77	9,409.77	金融地产
601988	中国银行	7,166.03	7,166.03	金融地产
601628	中国人寿	4,968.49	4,968.49	金融地产
600028	中国石化	4,548.55	4,548.55	能源
600000	浦发银行	3,523.78	3,344.57	金融地产
601318	中国平安	3,445.87	3,445.87	金融地产
600036	招商银行	3,319.20	3,319.20	金融地产
600519	贵州茅台	3,110.85	3,110.85	主要消费

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	3	0.84	274.36	1.08
100~500 亿	106	26.50	31757.59	39.27
500~1000 亿	36	83.72	25574.79	84.21
1000~5000 亿	31	96.88	64513.86	97.56
5000 亿元以上	4	100	40464.43	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	3	0.75	1243.27	1.54
500~1000 亿	13	30.23	10582.60	34.85
1000~5000 亿	30	93.75	62487.66	94.50
5000 亿元以上	4	100	40464.43	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	19	8.56	857.17	9.56
50~100 亿	156	43.82	11756.66	46.08
100~200 亿	155	60.55	21717.58	60.56
200~500 亿	46	31.94	12169.91	27.03
500 亿元以上	4	5.06	2798.27	2.04

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	69	1332.01	1299.01
30~50 亿	226	9110.88	7907.74
50~100 亿	359	25688.48	21015.00
100~200 亿	257	35973.18	27580.23
200~500 亿	144	45016.67	37840.98
500 亿元以上	79	136960.30	124719.63

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 (2016.03.31)	季度涨跌%		
上证 180 系列							
000010	上证 180	7986.39	2016-01-04	6051.99	2016-02-29	6921.88	-13.43
000016	上证 50	2417.03	2016-01-04	1891.10	2016-02-29	2156.54	-10.92
000018	180 金融	4891.43	2016-01-04	3833.09	2016-02-29	4395.88	-10.49
000021	180 治理	922.46	2016-01-04	700.60	2016-02-29	799.66	-13.41
000025	180 基建	2037.39	2016-01-04	1463.33	2016-02-29	1664.86	-18.19
000026	180 资源	2346.01	2016-01-04	1861.22	2016-02-01	2171.18	-7.34
000027	180 运输	1179.71	2016-01-04	820.08	2016-02-29	933.12	-21.09
000043	超大盘	2111.82	2016-01-04	1643.65	2016-02-29	1868.78	-11.46
000044	上证中盘	3865.65	2016-01-04	2779.14	2016-02-29	3195.89	-17.30
000050	50 等权	2475.30	2016-01-04	1865.85	2016-02-29	2157.91	-12.79
000054	上证海外	1154.38	2016-01-04	897.37	2016-02-29	1023.31	-11.69
上证 180 风格指数							
000028	180 成长	2870.66	2016-01-04	2216.29	2016-02-29	2551.59	-11.41
000029	180 价值	3559.81	2016-01-04	2850.14	2016-02-29	3183.57	-10.83
000030	180R 成长	2005.30	2016-01-04	1454.84	2016-02-29	1708.39	-14.86
000031	180R 价值	2852.91	2016-01-04	2241.40	2016-02-29	2508.77	-12.19
上证规模指数							
000009	上证 380	6715.84	2016-01-04	4622.85	2016-01-29	5422.17	-19.23
000045	上证小盘	5701.78	2016-01-04	3911.33	2016-01-29	4588.54	-19.45
000046	上证中小	4682.22	2016-01-04	3300.18	2016-01-29	3819.77	-18.37
000047	上证全指	3372.10	2016-01-04	2497.54	2016-02-29	2864.03	-15.13
上证全指风格指数							
000057	全指成长	3398.43	2016-01-04	2586.74	2016-02-29	2975.75	-12.64
000058	全指价值	3609.47	2016-01-04	2823.27	2016-02-29	3188.19	-11.91
000059	全 R 成长	3106.32	2016-01-04	2209.66	2016-01-27	2592.84	-16.51
000060	全 R 价值	3564.22	2016-01-04	2721.93	2016-02-29	3070.33	-13.98
上证行业指数							
000032	上证能源	1630.48	2016-01-04	1292.71	2016-02-03	1460.33	-10.20
000033	上证材料	1937.29	2016-01-04	1389.12	2016-01-29	1677.85	-13.25
000034	上证工业	2716.55	2016-01-04	1898.56	2016-02-29	2186.25	-19.02
000035	上证可选	3292.91	2016-01-04	2307.36	2016-02-29	2695.15	-18.23
000036	上证消费	6246.73	2016-01-04	4703.55	2016-01-27	5581.28	-10.86
000037	上证医药	6704.16	2016-01-04	4804.78	2016-01-27	5541.21	-17.53
000038	上证金融	4616.55	2016-01-04	3655.96	2016-02-29	4162.05	-10.20
000039	上证信息	5123.75	2016-01-04	3417.58	2016-03-01	4156.02	-18.83
000040	上证电信	3357.68	2016-01-04	2137.87	2016-01-29	2595.83	-22.04
000041	上证公用	2712.68	2016-01-04	1988.87	2016-02-29	2226.04	-17.80

代码	简称	最高 (日期)	最低 (日期)	收盘 (2016. 03. 31)	季度涨跌%		
上证行业策略指数							
000070	能源等权	2843.93	2016-01-06	2228.35	2016-02-01	2547.81	-10.02
000071	材料等权	3138.33	2016-01-04	2217.63	2016-01-29	2694.51	-14.01
000072	工业等权	3614.45	2016-01-04	2518.15	2016-02-29	2909.16	-18.99
000073	可选等权	3951.81	2016-01-04	2706.44	2016-01-27	3194.87	-19.30
000074	消费等权	6135.29	2016-01-04	4348.76	2016-01-27	5072.68	-17.46
000075	医药等权	9358.22	2016-01-04	6534.21	2016-01-27	7630.88	-18.59
000076	金融等权	4972.15	2016-01-04	3821.44	2016-02-29	4399.11	-11.84
000077	信息等权	6869.15	2016-01-04	4431.39	2016-03-01	5386.42	-21.51
000078	电信等权	3262.56	2016-01-04	2074.17	2016-01-27	2562.01	-21.26
000079	公用等权	3221.51	2016-01-04	2312.03	2016-01-28	2603.09	-19.12
上证央企、民企、国企主题指数							
000042	上证央企	1569.64	2016-01-04	1178.36	2016-02-29	1347.97	-13.96
000049	上证民企	1762.38	2016-01-04	1297.89	2016-01-27	1511.21	-14.42
000055	上证地企	1091.74	2016-01-04	845.72	2016-01-28	974.63	-11.00
000056	上证国企	1015.95	2016-01-04	778.81	2016-02-29	887.97	-12.65
上证其他主题指数							
000015	红利指数	2782.42	2016-01-04	2148.15	2016-02-29	2412.31	-13.38
000048	责任指数	1288.11	2016-01-04	1005.75	2016-02-29	1131.09	-12.48
000062	上证沪企	2586.77	2016-01-04	1902.58	2016-01-28	2193.82	-15.26
000063	上证周期	2983.99	2016-01-04	2348.91	2016-02-29	2671.89	-10.76
000064	非周期	2794.18	2016-01-04	2012.42	2016-02-29	2332.48	-16.27
000065	上证龙头	3421.55	2016-01-04	2530.21	2016-02-29	2909.94	-14.94
000066	上证商品	1825.37	2016-01-04	1341.83	2016-01-29	1588.33	-12.90
000067	上证新兴	7954.11	2016-01-04	5551.88	2016-01-29	6593.90	-16.67
000068	上证资源	1992.92	2016-01-04	1503.96	2016-02-01	1788.13	-10.19
000069	消费 80	4035.32	2016-01-04	2977.11	2016-01-27	3447.68	-14.76
上证综合类指数							
000001	上证指数	3538.69	2016-01-04	2638.30	2016-01-27	3003.92	-15.12
000002	A 股指数	3703.78	2016-01-04	2760.92	2016-01-27	3143.56	-15.14
000003	B 股指数	426.98	2016-01-04	330.06	2016-01-27	375.16	-12.02
000004	工业指数	2822.21	2016-01-04	2059.79	2016-01-27	2368.69	-15.92
000005	商业指数	5622.54	2016-01-04	3786.53	2016-03-01	4529.26	-19.84
000006	地产指数	6548.23	2016-01-04	5005.33	2016-01-27	5489.09	-16.42
000007	公用指数	6985.78	2016-01-04	4962.19	2016-02-29	5745.28	-17.82
000008	综合指数	3042.57	2016-01-04	2326.60	2016-02-29	2654.51	-12.86
000017	新综指	2986.74	2016-01-04	2226.63	2016-01-27	2535.10	-15.13
000020	中型综指	1858.35	2016-01-04	1259.19	2016-01-29	1516.81	-18.35
000090	上证流通	1296.16	2016-01-04	946.10	2016-01-28	1089.80	-15.97
上证行业指数固定收益指数							
000012	国债指数	156.63	2016-03-31	154.58	2016-01-04	156.63	1.35
000013	企债指数	201.41	2016-03-31	197.23	2016-01-04	201.41	2.18
000022	沪公司债	174.27	2016-03-31	171.37	2016-01-05	174.27	1.73
000061	沪企债 30	142.21	2016-03-10	140.05	2016-01-12	142.06	1.38
上证基金类指数							
000011	基金指数	5902.40	2016-01-04	5443.92	2016-02-29	5655.37	-4.23

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	510710.0F	1.65
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	511220.0F	62.84
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	510680.0F	0.19
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	511210.0F	0.96
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	510450.0F	0.06
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	510650.0F	1.09
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	510610.0F	0.31
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	510660.0F	1.50
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	510620.0F	0.22
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	510630.0F	2.51
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	511010.0F	4.80
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	510430.0F	0.95
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	510420.0F	2.17
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	510410.0F	0.80
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	510290.0F	2.78
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	510280.0F	0.64
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	510270.0F	0.26
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	510120.0F	0.34
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	510260.0F	0.89
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	510230.0F	31.51
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	510210.0F	1.42
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	510220.0F	0.27
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	510150.0F	1.31
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	510170.0F	1.44
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	510190.0F	1.27
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	510110.0F	0.50
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	510070.0F	0.87
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	510090.0F	1.07
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	510030.0F	1.41
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	510130.0F	2.73
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	510020.0F	2.28
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	510010.0F	5.96
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	510060.0F	2.50
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	510880.0F	5.87
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	510180.0F	166.79
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	510050.0F	279.65
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	BOC1.GR	0.12
上证 50 指数	中银保诚标智上证 50ETF	香港交易所	3024.HK	0.76
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	9.85
上证 50 指数	野村上证 50ETF	大阪证券交易所	1309.0	3.09
上证 50 指数	大华上证 50ETF	新加坡交易所	USSE50.SP	1.48
上证 180 指数	富邦上证 180ETF	台湾证券交易所	006205.TW	33.55
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	59.08
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	2.97

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	502040.0F	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	001548.0F	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	502020.0F	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	502048.0F	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	590007.0F	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	399001.0F	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	470007.0F	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	110003.0F	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	519180.0F	18.87

1. 流通市值覆盖率

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

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

其中， MV_I - 指数 2010-12-31 的流通市值；

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

2. 总市值覆盖率

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

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

其中， TMV_I - 指数 2010-12-31 的总市值；

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

3. 样本股日均成交金额

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

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

4. 换手率

考察指数的成交活跃程度，反映指数流动性的高低。

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

其中， TO - 换手率；

TTV - 总成交量；

TMN - 流通股本；

TV_i - 指数中第 i 只股票的成交量；

MN_i - 指数中第 i 只股票的流通股本

5. 税后利润

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

其中， PNP_I - 指数的税后利润；

Jlr_i - 指数中第 i 只股票的净利润；

TN_i - 指数中第 i 只股票的 A 股股本；

PN_i - 指数中第 i 只股票的公司股本（含 A、H 等股本）。

6. 每股收益

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

其中， PNP_I - 指数的每股收益；

Jlr_i - 指数中第 i 只股票的净利润；

TN_i - 指数中第 i 只股票的 A 股股本；

PN_i - 指数中第 i 只股票的公司股本（含 A、H 等股本）。

7. 股东权益

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

其中， PNA_I - 指数的股东权益；

Jzc_i - 指数中第 i 只股票的净资产；

TN_i - 指数中第 i 只股票的 A 股股本；

PN_i - 指数中第 i 只股票的公司股本（含 A、H 等股本）。

8. 每股净资产

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

其中， PNA_I - 指数的每股净资产；

Jzc_i - 指数中第 i 只股票的净资产；

TN_i - 指数中第 i 只股票的 A 股股本；

PN_i - 指数中第 i 只股票的公司股本（含 A、H 等股本）。

9. 总资产收益率

从总资产的角度考察指数样本股的收益情况，反映指数样本股与实体经济的关系。

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

其中，ROTA- 总资产收益率；

TNP - 净利润（含少数股东损益）；

TA- 资产总额；

NP_i - 指数中第 i 只股票的净利润；

TA_i - 指数中第 i 只股票的总资产。

TN_i - 指数中第 i 只股票的 A 股股本；

PN_i- 指数中第 i 只股票的公司股本（含 A、H 等股本）。

10. 净资产收益率

考察指数样本股的股权资产的收益情况，反映指数样本股与实体经济的关系。

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

其中，ROE - 净资产收益率

TNP - 净利润总额；

TNA- 净资产总额；

NP_i - 指数中第 i 只股票的净利润；

NA_i - 指数中第 i 只股票的净资产。

TN_i - 指数中第 i 只股票的 A 股股本；

PN_i- 指数中第 i 只股票的公司股本（含 A、H 等股本）。

11. 股东权益比率

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

其中，ROR - 股东权益比率；

TPR- 股东权益（含少数股东权益）；

TA - 资产总额；

PR_i- 指数中第 i 只股票的股东权益；

TA_i - 指数中第 i 只股票的总资产。

TN_i - 指数中第 i 只股票的 A 股股本；

PN_i - 指数中第 i 只股票的公司股本（含 A、H 等股本）。

12. 资产负债比率

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

其中，ROD- 资产负债比率；

PR_i- 指数中第 i 只股票的股东权益（含少数股东权益）；

TA_i - 指数中第 i 只股票的总资产。

TN_i - 指数中第 i 只股票的 A 股股本；

PN_i- 指数中第 i 只股票的公司股本（含 A、H 等股本）。

13. 季度末市值规模分布

上证 180、50、380 指数成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