

2015年5月 深证指数及国证指数运行报告

深圳证券信息有限公司指数事业部

市场回顾

2015年5月份，市场呈现普遍上涨行情。核心指数中，中小板指数表现最佳，本月上涨25.01%。

行业指数方面，深证行业指数中，深证电信指数单月涨幅为27.37%，在深证行业指数中涨幅最大。国证行业指数中，国证航天软件指数表现最好，单月涨幅为32.85%。

主题指数方面，深证系列主题指数中，中创高新指数表现最优，涨幅为33.34%。国证主题系列指数中，国证航天军工指数表现最佳，涨幅为32.78%。

人民币系列指数中，人民币指数和人民币实际指数本月均下跌1.78%，近一年涨幅则分别为14.11%和13.80%。

深证系列指数		2015年5月收益表现最佳指数			
指数代码	指数简称	近1个月	近3个月	近6个月	近1年
399668	创业300价值	37.14%	110.05%	119.63%	196.70%
国证系列指数		2015年5月收益表现最佳指数			
指数代码	指数简称	近1个月	近3个月	近6个月	近1年
399307	深证转债指数	41.65%	63.51%	97.36%	161.36%

注：近1个月、近3个月、近6个月和近1年为累计收益率，下同。

规模指数

表 1 深证系列规模指数运行统计

指数代码	指数名称	近 1 个月	近 3 个月	近 6 个月	近 1 年	年化波动率
399012	创业板 300	31.23%	98.57%	127.97%	193.82%	34.42%
399624	中创 400	30.86%	88.92%	106.97%	170.29%	30.18%
399015	中小创新	30.18%	89.56%	101.52%	182.15%	28.47%
399010	深证 700	27.62%	85.19%	99.31%	175.41%	28.06%
399625	中创 500	26.93%	79.95%	106.14%	157.81%	30.28%
399008	中小板 300	26.86%	74.21%	97.03%	146.79%	29.41%
399005	中小板指	25.01%	67.05%	96.38%	135.87%	30.59%
399006	创业板指	23.97%	87.03%	125.54%	168.78%	35.90%
399611	中创 100R	21.81%	68.84%	105.57%	143.19%	31.39%
399612	中创 100	21.70%	68.51%	105.16%	141.67%	31.39%
399009	深证 200	20.20%	73.16%	101.10%	162.06%	28.51%
399011	深证 1000	19.44%	66.02%	92.45%	152.84%	27.42%
399007	深证 300	13.76%	53.65%	87.47%	137.67%	27.84%
399330	深证 100	9.11%	41.03%	77.42%	121.11%	28.70%
399001	深证成指	8.65%	37.39%	78.85%	118.61%	29.93%

注：近1个月、近3个月、近6个月、近1年为累计收益；年化波动率根据当年日收益率的波动折算，下同。

表 2 国证系列规模指数运行统计

指数代码	指数名称	近 1 个月	近 3 个月	近 6 个月	近 1 年	年化波动率
399303	国证 2000	29.02%	91.05%	102.79%	195.63%	27.31%
399316	巨潮小盘	19.44%	72.55%	91.64%	168.17%	27.93%
399401	中小盘	17.05%	66.53%	89.60%	159.71%	28.31%
399315	巨潮中盘	14.89%	61.25%	87.74%	151.67%	28.93%
399311	国证 1000	7.71%	48.10%	80.19%	138.31%	28.14%
399400	大中盘	4.66%	42.13%	76.95%	130.37%	29.02%
399312	国证 300	2.20%	38.48%	75.17%	128.68%	29.90%
399314	巨潮大盘	0.53%	34.76%	72.18%	121.57%	30.44%
399313	巨潮 100	-2.10%	29.68%	65.65%	110.59%	32.07%
399310	国证 50	-3.50%	22.94%	55.94%	97.39%	34.60%

注：近 1 个月、近 3 个月、近 6 个月、近 1 年为累计收益；年化波动率根据当年日收益率的波动折算，下同。

表 3 规模指数市值及财务指标

指数代码	指数名称	总市值	自由流通 市值	总市值 覆盖率	静态 PE	滚动 PE	股息率	ROE
399001	深证成指	143839.20	66448.40	54.18%	52.70	51.90	0.49%	9.97%
399005	中小板指	35520.23	15813.64	31.28%	60.28	58.40	0.45%	11.66%
399006	创业板指	26088.17	12464.15	42.00%	125.00	123.12	0.17%	10.64%
399330	深证 100	60355.55	28883.09	22.74%	34.59	34.13	0.75%	11.76%
399007	深证 300	110606.97	51826.99	41.67%	46.08	45.27	0.56%	10.72%
399009	深证 200	50251.42	22943.90	18.93%	76.80	74.58	0.33%	8.67%
399010	深证 700	91681.22	40349.57	34.54%	110.54	109.52	0.27%	6.06%
399011	深证 1000	202288.18	92176.56	76.20%	62.63	61.66	0.43%	8.95%
399008	中小板 300	67040.33	28875.87	59.04%	73.33	71.64	0.38%	9.65%
399012	创业板 300	46204.89	21327.38	74.38%	139.31	137.25	0.18%	8.14%
399015	中小创新	58448.98	25728.16	22.02%	116.81	114.84	0.28%	5.74%
399612	中创 100	41121.62	19092.59	23.41%	65.05	63.33	0.40%	12.18%
399625	中创 500	104341.22	46416.95	59.40%	87.16	85.08	0.32%	9.17%
399624	中创 400	63219.60	27324.36	35.99%	111.90	109.59	0.27%	7.18%
399310	国证 50	151321.95	45400.41	24.23%	12.09	12.17	2.53%	13.94%
399313	巨潮 100	199773.71	66055.22	31.98%	14.33	14.36	2.13%	13.68%
399312	国证 300	297206.30	108317.79	47.58%	18.89	18.76	1.61%	12.68%
399311	国证 1000	440364.51	172068.12	70.50%	25.00	24.85	1.22%	11.57%
399314	巨潮大盘	254847.52	90731.33	40.80%	16.99	16.93	1.79%	13.17%
399315	巨潮中盘	97076.10	41729.98	15.54%	64.02	61.98	0.51%	7.37%
399316	巨潮小盘	88440.89	39606.81	14.16%	81.90	81.39	0.38%	6.08%
399400	大中盘	351923.62	132461.31	56.34%	21.30	21.17	1.44%	12.29%
399401	中小盘	185516.99	81336.79	29.70%	71.45	69.92	0.45%	6.78%
399303	国证 2000	144731.52	61814.12	23.17%	146.39	146.94	0.26%	4.51%

注：深证成指、深证 100、深证 200、深证 300、深证 700，中小创新和深证 1000 为相对深市 A 股市值的覆盖率；中小板指和中小 300 为相对中小板市值的覆盖率；创业板指和创业 300 为相对创业板市值的覆盖率；中创 100、中创 400 和中创 500 为相对中小板和创业板市值的覆盖率；国证系列指数为沪深 A 股市值的覆盖率。静态 PE 取自 2014 年年度净利润，滚动 PE 取自近四个季度净利润。

行业指数

表 4 深证系列行业指数运行统计

指数代码	指数名称	近 1 个月	近 3 个月	近 6 个月	近 1 年	年化波动率
399613	深证能源指数	7.97%	49.36%	65.20%	110.39%	32.46%
399614	深证材料指数	17.22%	64.33%	82.72%	151.18%	28.49%
399615	深证工业指数	23.96%	76.00%	98.69%	169.74%	28.83%
399616	深证可选消费	19.36%	55.98%	95.48%	129.17%	29.45%
399617	深证主要消费	12.84%	49.69%	66.84%	90.16%	27.84%
399618	深证医药卫生	18.62%	60.65%	74.98%	107.00%	30.24%
399619	深证金融地产	-2.20%	25.99%	65.38%	157.34%	35.68%
399620	深证信息技术	25.90%	80.32%	127.10%	173.38%	33.87%
399621	深证电信指数	27.37%	75.13%	98.07%	157.65%	32.17%
399622	深证公用事业	14.07%	60.53%	87.89%	199.37%	32.53%

表 5 国证系列行业指数运行统计

指数代码	指数名称	近 1 个月	近 3 个月	近 6 个月	近 1 年	年化波动率
399381	国证 1000 能源	-1.30%	35.80%	49.87%	79.19%	37.35%
399382	国证 1000 材料	10.27%	51.22%	73.74%	133.51%	30.18%
399383	国证 1000 工业	8.57%	72.44%	108.94%	199.05%	32.37%
399384	国证 1000 可选	13.64%	50.19%	81.35%	123.95%	29.92%
399385	国证 1000 消费	9.42%	43.65%	61.35%	86.98%	27.83%
399386	国证 1000 医药	16.41%	58.55%	73.66%	106.54%	27.16%
399387	国证 1000 金融	-3.28%	22.27%	57.08%	120.74%	35.79%
399388	国证 1000 信息	23.73%	77.61%	122.53%	179.80%	33.71%
CN5110	国证 1000 电信	27.57%	82.63%	124.77%	173.58%	31.90%
399390	国证 1000 公用	7.40%	53.24%	83.91%	158.56%	38.97%
399431	国证银行指数	-4.88%	19.19%	39.85%	75.41%	36.75%
399432	国证汽车指数	9.61%	35.23%	60.90%	112.78%	30.03%
399433	国证交运指数	1.18%	59.58%	88.34%	190.10%	38.20%
399434	国证传媒指数	20.51%	56.44%	86.04%	115.00%	36.63%
399435	国证农牧指数	19.85%	64.97%	70.41%	127.90%	31.02%
399436	国证煤炭指数	1.10%	39.29%	50.81%	99.18%	39.52%
399437	国证证券指数	-6.87%	16.57%	68.58%	201.62%	46.53%
399438	国证电力指数	8.05%	56.75%	85.65%	160.94%	41.55%
399439	国证油气指数	-4.62%	32.05%	50.31%	72.00%	38.73%
399440	国证钢铁指数	2.99%	53.11%	89.99%	190.65%	39.02%
CN5073	国证能源指数	-0.62%	37.28%	54.55%	83.41%	34.32%
CN5074	国证非银指数	-5.44%	15.34%	67.68%	167.36%	40.10%
CN5075	国证软件指数	24.14%	84.20%	163.30%	253.46%	44.09%

CN5076	国证生科指数	27.25%	82.48%	95.30%	149.20%	29.37%
CN5077	国证电影指数	27.14%	65.08%	85.86%	119.86%	45.00%
CN5078	国证家电指数	10.80%	49.07%	90.66%	116.66%	33.30%
CN5079	国证中药指数	14.69%	54.38%	71.68%	95.97%	31.26%
CN5080	国证建材指数	9.80%	47.84%	65.71%	122.93%	30.69%
CN5081	国证白酒指数	3.91%	34.61%	58.54%	81.04%	36.74%
CN5082	国证航天指数	32.85%	90.26%	122.80%	237.26%	44.46%
CN5083	国证半导体指数	30.42%	82.39%	104.37%	145.62%	33.64%
CN5084	电信服务指数	6.18%	64.47%	120.34%	179.51%	39.78%
CN5085	服装纺织指数	24.40%	81.75%	106.28%	193.26%	29.11%
CN5086	工业服务指数	0.61%	67.83%	113.81%	201.06%	37.09%
CN5087	工业用品指数	19.88%	83.16%	112.06%	199.50%	29.78%
CN5088	国证公用指数	7.54%	54.21%	83.72%	158.59%	38.77%
CN5089	国证材料指数	8.08%	52.31%	72.87%	136.42%	31.04%
CN5090	国证化工指数	22.93%	67.72%	86.70%	152.37%	29.02%
CN5091	电脑硬件指数	28.63%	77.94%	100.38%	142.32%	31.92%
CN5092	国证家用指数	14.35%	48.11%	57.82%	83.50%	32.79%
CN5093	国证零售指数	21.79%	75.31%	106.08%	166.33%	34.46%
CN5094	耐用消费指数	13.13%	55.59%	100.22%	126.86%	33.02%
CN5095	食品零售指数	18.40%	60.70%	83.80%	131.93%	31.47%
CN5096	国证通信指数	32.05%	80.03%	104.50%	170.14%	31.92%
CN5097	消费服务指数	16.15%	67.30%	84.61%	144.10%	28.01%
CN5098	国证医疗指数	21.79%	75.74%	103.75%	129.85%	44.43%
CN5099	国证制药指数	15.63%	58.34%	72.10%	102.61%	28.81%
CN5100	白色家电指数	6.69%	38.95%	82.02%	99.87%	39.25%
CN5101	国证百货指数	13.34%	70.70%	97.69%	150.12%	31.17%
CN5102	国证空运指数	-5.66%	66.58%	91.00%	238.63%	53.72%
CN5103	网络软件指数	4.16%	71.25%	196.21%	281.27%	46.58%
CN5104	建筑工程指数	-7.04%	69.02%	132.66%	245.98%	47.19%
CN5105	路桥港口指数	3.60%	51.25%	73.53%	166.37%	37.08%
CN5106	酒店餐饮指数	17.01%	67.60%	84.13%	142.58%	26.09%
CN5107	国证水务指数	-0.31%	29.32%	61.62%	141.52%	38.72%
CN5108	国证机械指数	19.32%	76.08%	83.48%	174.09%	30.37%

风格指数

表 6 深证系列、中小板系列、中创系列风格指数运行统计

指数代码	指数名称	近 1 个月	近 3 个月	近 6 个月	近 1 年	年化波动率
399346	深证 300 成长	13.53%	48.43%	82.95%	109.13%	28.12%
399348	深证 300 价值	5.57%	39.77%	70.12%	117.99%	29.47%
399628	深证 700 成长	28.94%	89.97%	110.77%	184.50%	29.75%
399629	深证 700 价值	22.16%	78.09%	88.00%	168.30%	28.76%
399630	深证 1000 成长	19.54%	64.03%	96.06%	139.02%	27.95%
399631	深证 1000 价值	11.09%	52.29%	78.89%	140.22%	28.29%
399602	中小 300 成长	25.77%	71.67%	104.62%	140.54%	30.15%
399604	中小 300 价值	21.74%	63.19%	87.56%	140.73%	29.95%
399667	创业 300 成长	28.83%	84.80%	124.34%	169.79%	37.23%
399668	创业 300 价值	37.14%	110.05%	119.63%	196.70%	33.31%
399626	中创 500 成长	24.60%	72.60%	108.24%	145.13%	31.84%
399627	中创 500 价值	22.85%	68.56%	89.96%	145.65%	29.61%

表 7 国证系列风格指数运行统计

指数代码	指数名称	近 1 个月	近 3 个月	近 6 个月	近 1 年	年化波动率
399370	国证 1000 成长	9.19%	46.71%	76.43%	116.74%	27.26%
399371	国证 1000 价值	0.10%	38.83%	70.20%	126.65%	31.82%
399372	1000 大盘成长	1.82%	33.16%	64.03%	96.40%	29.85%
399373	1000 大盘价值	-5.19%	28.85%	62.86%	109.37%	34.34%
399374	1000 中盘成长	16.22%	57.67%	82.80%	123.94%	28.06%
399375	1000 中盘价值	6.99%	56.17%	84.54%	160.32%	32.87%
399376	1000 小盘成长	22.76%	76.77%	101.77%	168.44%	28.56%
399377	1000 小盘价值	14.62%	63.44%	80.67%	162.99%	30.55%

主题指数

表 8 深证系列主题指数运行统计

指数代码	指数名称	近 1 个月	近 3 个月	近 6 个月	近 1 年	年化波动率
399652	中创高新指数	33.34%	99.08%	138.71%	206.83%	35.90%
399642	中小新兴产业	28.63%	74.46%	101.68%	144.65%	31.82%
399643	创业新兴产业	28.34%	92.70%	133.48%	186.74%	35.95%
399608	深证科技 100	26.40%	77.54%	103.74%	148.47%	33.12%
399650	中小治理指数	23.01%	59.01%	94.06%	127.68%	32.12%
399651	中小责任指数	21.97%	54.78%	90.80%	131.37%	31.19%
399339	深证科技指数	21.08%	70.78%	104.67%	147.26%	31.09%
399649	中小红利指数	20.49%	69.18%	91.45%	132.33%	30.27%

399610	深证 TMT50	20.29%	70.40%	123.62%	153.48%	33.37%
399641	深证新兴产业	20.01%	68.70%	101.78%	148.84%	29.95%
399654	深证文化指数	19.78%	67.90%	123.16%	161.24%	33.29%
399647	深证医药 50	19.55%	59.78%	72.28%	107.11%	29.56%
399636	深证装备指数	19.14%	67.18%	89.20%	147.42%	29.67%
399671	深证防御 50	15.72%	49.30%	74.59%	98.21%	30.24%
399337	深证民营指数	15.40%	55.57%	91.71%	133.10%	29.25%
399669	深证农业指数	14.65%	51.74%	69.06%	109.26%	28.40%
399638	深证环保指数	14.61%	65.05%	89.72%	137.40%	29.96%
399013	深市精选指数	14.23%	50.99%	81.68%	131.78%	27.73%
399646	深证消费 50	14.13%	44.08%	78.77%	107.72%	29.96%
399335	深证央企指数	12.58%	43.14%	79.60%	139.02%	29.12%
399653	深证龙头指数	11.24%	40.29%	79.29%	108.70%	29.43%
399332	深证创新指数	10.33%	46.28%	82.58%	114.74%	30.11%
399341	深证责任指数	7.35%	40.19%	73.62%	113.65%	29.40%
399639	深证大宗商品	7.13%	45.97%	62.00%	122.09%	33.32%
399328	深证治理指数	5.67%	33.99%	67.23%	96.35%	30.88%
399637	深证地产指数	4.84%	51.81%	85.66%	163.98%	34.07%
399670	深证周期 50	3.53%	30.89%	63.01%	121.74%	29.58%
399324	深证红利指数	2.58%	31.44%	67.96%	117.10%	31.48%

表 9 国证系列主题指数运行统计

指数代码	指数名称	近 1 个月	近 3 个月	近 6 个月	近 1 年	年化波动率
399368	国证航天军工	32.78%	91.07%	129.26%	255.44%	38.00%
399441	国证生物医药	27.66%	80.70%	95.57%	150.27%	27.40%
399363	国证科技指数	27.49%	77.54%	116.68%	162.54%	31.38%
399418	国证国家安全	24.05%	74.79%	104.98%	186.67%	31.91%
399428	国证定向增发	22.88%	87.53%	118.71%	232.36%	30.20%
399392	国证新兴产业	19.80%	72.02%	106.81%	158.37%	29.85%
399412	国证新能指数	18.17%	65.79%	86.41%	147.26%	28.77%
399361	国证商业连锁	16.90%	63.23%	90.39%	143.38%	32.69%
399394	国证医药指数	16.70%	61.07%	76.81%	103.29%	28.74%
399360	国证装备指数	14.41%	76.20%	117.10%	189.33%	32.94%
399362	国证民营指数	12.78%	51.56%	87.25%	135.17%	27.59%
399419	国证高铁指数	11.93%	83.99%	138.33%	305.10%	34.69%
399403	国证防御 100	11.77%	48.98%	73.00%	99.87%	27.85%
399396	国证食品指数	8.78%	41.58%	60.19%	79.83%	28.15%
399365	国证农业指数	8.45%	41.21%	60.14%	87.73%	28.65%
399320	国证服务指数	6.57%	58.09%	90.07%	162.93%	34.07%
399353	国证物流指数	16.27%	50.67%	69.22%	150.36%	27.49%
399395	国证有色指数	15.78%	40.14%	59.95%	77.74%	24.74%
399366	国证大宗商品	15.58%	41.69%	106.88%	154.30%	34.45%

Index Statistics Report May 2015

399367	国证地产指数	15.21%	48.02%	68.59%	109.96%	28.42%
399393	国证地产指数	15.11%	31.96%	51.99%	59.91%	26.16%
399319	国证资源优势	14.28%	44.73%	78.37%	109.11%	23.91%
399322	国证治理指数	14.26%	39.88%	100.56%	141.84%	33.53%
399402	国证周期 100	13.67%	48.55%	51.31%	99.33%	26.92%
399359	国证基建指数	13.53%	31.31%	53.92%	68.74%	25.45%
399321	国证红利指数	12.78%	28.57%	72.68%	93.36%	29.73%
399420	国证保证指数	12.67%	31.56%	96.46%	133.03%	31.60%

区域指数

表 10 国证系列区域指数运行统计

指数代码	指数名称	近 1 个月	近 3 个月	近 6 个月	近 1 年	年化波动率
399351	深圳报业指数	1.24%	30.80%	71.69%	118.11%	33.72%
399355	长三角指数	0.69%	32.66%	67.68%	130.62%	32.25%
399356	珠三角指数	0.59%	30.92%	73.32%	120.15%	33.74%
399357	环渤海指数	-2.08%	32.61%	63.99%	102.48%	34.22%
CN6011	黑龙江指	28.92%	90.76%	135.16%	238.32%	33.18%
CN6015	江苏指数	26.80%	77.80%	98.76%	179.30%	27.15%
CN6030	浙江指数	24.22%	79.50%	103.67%	173.68%	28.84%
CN6010	河南指数	21.30%	67.01%	82.78%	141.68%	26.03%
CN6013	湖南指数	21.07%	66.80%	85.64%	159.53%	27.58%
CN6009	河北指数	7.87%	43.75%	69.16%	135.31%	30.45%
CN6026	天津指数	7.48%	57.61%	78.73%	140.14%	27.82%
CN6024	上海指数	6.94%	49.79%	82.57%	160.33%	29.31%
CN6002	北京指数	6.94%	53.53%	92.29%	159.62%	29.23%
CN6022	山西指数	2.48%	38.33%	48.34%	121.72%	35.16%

注：31 只省级区域指数目前采取线下发布方式；本表仅罗列区域综合指数中涨幅排名前 5、后 5 的数据。

策略指数

表 11 深证系列策略指数运行统计

指数代码	指数名称	近 1 个月	近 3 个月	近 6 个月	近 1 年	年化波动率
399632	深证 100 等权	12.07%	48.15%	90.23%	145.14%	28.50%
399633	深证 300 等权	18.27%	63.79%	97.60%	161.90%	28.06%
399634	中小板等权	26.01%	71.77%	98.77%	150.68%	30.23%
399635	创业板等权	28.49%	90.54%	120.24%	169.64%	34.91%
399645	深证 100 低波	7.56%	40.39%	76.64%	143.96%	28.59%

399655	深证绩效指数	21.03%	61.76%	84.31%	120.80%	28.90%
399656	深证 100 绩效	11.83%	47.49%	80.58%	113.25%	28.51%
399657	深证 300 绩效	19.01%	62.49%	93.08%	141.16%	28.19%
399658	中小板指绩效	25.06%	69.60%	96.47%	134.30%	29.90%
399659	深证成份等权	13.13%	44.72%	98.82%	149.61%	29.61%
399660	中创 100 等权	22.47%	69.01%	103.48%	150.53%	30.62%
399661	深证 300 低波	11.52%	49.89%	80.98%	157.17%	28.02%
399662	深证 300 高贝	22.56%	72.51%	111.71%	173.00%	30.79%
399663	中小 300 低波	22.21%	71.45%	85.35%	156.03%	27.75%
399664	中小 300 高贝	34.88%	91.33%	113.59%	178.24%	32.66%
399665	中创 500 低波	23.94%	77.46%	88.62%	156.95%	27.84%
399666	中创 500 高贝	32.21%	92.26%	115.07%	183.71%	33.47%
399672	深红利 50 指数	11.50%	53.58%	77.63%	138.56%	27.74%
399673	创业板 50 指数	19.86%	82.01%	127.72%	165.60%	38.55%

表 12 国证系列策略指数运行统计

指数代码	指数名称	近 1 个月	近 3 个月	近 6 个月	近 1 年	年化波动率
399398	绩效指数	15.54%	49.59%	74.31%	108.81%	28.29%
399404	大盘低波	-2.24%	37.26%	80.91%	142.15%	32.35%
399405	大盘高贝	0.10%	31.61%	72.80%	155.16%	32.98%
399406	中盘低波	9.85%	56.30%	90.63%	178.73%	29.56%
399407	中盘高贝	23.34%	69.83%	95.54%	150.03%	30.61%
399408	小盘低波	16.90%	65.47%	86.18%	171.57%	28.10%
399409	小盘高贝	24.88%	76.74%	100.54%	175.11%	29.94%
399411	红利 100	5.69%	44.36%	70.60%	129.79%	30.16%
399427	专利领先	18.77%	76.56%	100.82%	188.10%	30.12%

定制指数

表 13 定制指数运行统计

指数代码	指数名称	近 1 个月	近 3 个月	近 6 个月	近 1 年	年化波动率
399326	深证成长 40	21.35%	58.61%	103.88%	120.28%	29.69%
399358	泰达环保指数	11.54%	53.86%	79.93%	120.49%	30.41%
399364	中金龙头消费	9.81%	43.37%	69.77%	95.92%	28.52%
399369	CBN-兴业责任	0.48%	39.30%	72.77%	116.27%	30.31%
399378	南方低碳指数	4.11%	43.27%	78.08%	128.56%	30.71%
399391	国证投资时钟	2.79%	40.69%	72.06%	108.76%	30.35%
399644	深证投资时钟	6.17%	37.62%	64.00%	107.58%	28.94%
399648	深证 GDP100	19.38%	57.77%	85.38%	141.88%	27.08%
399397	华侨城文化	14.85%	61.33%	102.73%	140.04%	31.65%
399399	中经 GDP 指数	6.29%	41.58%	79.98%	129.63%	28.61%
399350	国元皖江 30	14.45%	54.81%	83.26%	155.60%	28.41%
399410	苏州率先指数	24.30%	69.46%	100.51%	198.43%	28.74%
CN5061	深证 GDP 对冲	9.23%	11.56%	3.74%	8.49%	9.33%
CN5062	中经 GDP 对冲	4.26%	2.80%	3.74%	1.46%	7.14%
399415	大数据 100 指数	28.59%	92.95%	94.99%	209.94%	31.68%
399416	大数据 300 指数	7.67%	45.02%	29.88%	92.32%	30.81%
399429	新丝路指数	11.42%	61.32%	80.97%	146.52%	30.17%
399423	中关村 50 指数	25.96%	69.62%	111.03%	163.20%	33.84%
CN5069	中关村 A 指	26.99%	83.60%	123.15%	197.26%	32.27%

表 14 央视 50 系列指数运行统计

指数代码	指数名称	近 1 个月	近 3 个月	近 6 个月	近 1 年	年化波动率
399550	央视 50 指数	8.68%	38.25%	68.47%	97.53%	29.66%
399551	央视创新指数	18.21%	66.88%	105.67%	143.57%	33.28%
399552	央视成长指数	5.85%	36.05%	68.18%	103.88%	28.64%
399553	央视回报指数	12.71%	43.84%	71.81%	98.60%	28.26%
399554	央视治理指数	4.98%	31.58%	61.05%	95.88%	31.06%
399555	央视责任指数	0.19%	25.11%	50.06%	86.09%	31.61%
399556	央视生态指数	18.28%	61.51%	85.19%	125.27%	29.12%
399557	央视文化指数	14.69%	64.63%	111.48%	145.37%	33.87%

人民币系列指数

表 15 人民币指数运行统计

指数代码	指数名称	近 1 个月	近 3 个月	近 6 个月	近 1 年	年化波动率
CNYX	人民币指数	1.78%	1.66%	4.47%	14.11%	4.91%
CNYR	人民币实际指数	1.78%	2.06%	5.32%	13.80%	5.07%

债券系列指数

表 16 债券指数运行统计

指数代码	指数名称	近 1 个月	近 3 个月	近 6 个月	近 1 年	年化波动率
399413	国证转债指数	11.93%	25.15%	53.29%	90.39%	33.35%
399307	深证转债指数	41.65%	63.51%	97.36%	161.36%	38.84%
399298	深信中高信用	1.30%	2.89%	4.15%	10.85%	0.99%
399299	深信中低信用	1.11%	2.56%	3.98%	9.65%	0.98%
399301	深证信用债	1.11%	2.62%	4.19%	10.39%	0.83%
399302	深证公司债	1.10%	2.58%	4.03%	10.21%	0.83%

基金系列指数

表 17 基金指数运行统计

指数代码	指数名称	近 1 个月	近 3 个月	近 6 个月	近 1 年	年化波动率
399103	乐富指数	5.94%	36.09%	59.68%	105.16%	24.60%
399305	基金指数	6.32%	31.35%	47.04%	83.75%	27.33%
399306	深证 ETF	5.22%	40.46%	74.31%	125.86%	29.85%
399379	国证基金	4.19%	34.67%	61.60%	109.13%	26.00%
399380	国证 ETF	2.27%	35.70%	67.45%	119.24%	29.45%
CN6070	中国股基指数	19.48%	57.45%	83.46%	123.79%	26.46%
CN6071	中国混基指数	13.98%	46.55%	67.11%	99.26%	21.15%
CN6072	中国债基指数	3.56%	7.76%	12.16%	24.16%	4.37%

399001 深证成份指数

本月收盘	本月涨幅	本月涨跌(点)	成交量	成交金额	样本数
16100.45	8.65%	1281.81	2567.57	50877.6	500
总市值	自由流通市值	总市值覆盖率	静态 PE	滚动 PE	股息率
143839.20	66448.40	54.18%	52.7	51.9	0.49%

注：“成交量”单位为“亿股”，“成交金额”、“总市值”、“自由流通市值”单位为“亿元”，下同。

权重前 10 名样本股

代码	简称	收盘	自由流通市值	权重%	代码	简称	收盘	自由流通市值	权重%
000651	格力电器	62.21	1346.60	2.03	002024	苏宁云商	18.53	710.02	1.07
000002	万科A	14.35	1151.79	1.73	000776	广发证券	25.83	707.16	1.06
000001	平安银行	15.32	912.05	1.37	000166	申万宏源	18.7	608.63	0.92
300059	东方财富	74.29	779.15	1.17	000783	长江证券	17.25	563.84	0.85
000333	美的集团	37	715.59	1.08	002415	海康威视	45.36	563.23	0.85

涨幅前 5 名样本股

代码	简称	收盘	涨幅%	贡献点数
002131	利欧股份	74.01	160.69	2.48
002276	万马股份	36.70	106.53	5.71
002698	博实股份	70.38	105.31	2.50
000883	湖北能源	13.03	102.64	9.25
000587	金叶珠宝	35.20	102.53	5.75

跌幅前 5 名样本股

代码	简称	收盘	涨幅%	贡献点数
000401	冀东水泥	16.30	-21.63	-1.28
002681	奋达科技	73.90	-19.06	-0.42
000905	厦门港务	20.42	-18.25	-0.29
000625	长安汽车	21.55	-14.48	-51.49
002146	荣盛发展	20.55	-12.81	0.01

行业分布 (2015.5.31)

行业	家数	权重 (%)	贡献点数
信息技术	88	20.82	511.23
工业	97	16.87	278.50
可选消费	69	16.28	286.77
金融地产	38	13.01	-122.58
原材料	79	11.48	126.93
医药卫生	52	8.88	81.28
主要消费	31	5.58	30.98
电信业务	21	3.47	40.03
公用事业	10	1.90	20.07
能源	15	1.71	28.60
总计	500	100	1281.80

市场分布 (2015.5.31)

市场	家数	权重 (%)	贡献点数
深市主板	199	47.32	32.28
深市中小板	211	35.89	915.09
深市创业板	90	16.79	334.43
沪市	/	/	/
总计	500	100	1281.80

样本股自由流通市值分布 (2015.5.31)

最大	最小	均值	中值
1346.60	16.12	132.90	92.34

399005 中小板指数

本月收盘	本月涨幅	本月涨跌(点)	成交量	成交金额	样本数
10972.11	25.01%	2194.93	692.4	19435.62	100
总市值	自由流通市值	总市值覆盖率	静态 PE	滚动 PE	股息率
35520.23	15813.64	31.28%	60.28	58.4	0.45%

注：“成交量”单位为“亿股”，“成交金额”、“总市值”、“自由流通市值”单位为“亿元”，下同。

权重前 10 名样本股

代码	简称	收盘	自由流通市值	权重%	代码	简称	收盘	自由流通市值	权重%
002024	苏宁云商	18.53	710.02	4.49	002594	比亚迪	76	386.70	2.45
002415	海康威视	45.36	563.23	3.56	002202	金风科技	23	338.97	2.14
002450	康得新	42.29	457.24	2.89	002405	四维图新	70	332.82	2.10
002183	怡亚通	73.15	442.57	2.80	002065	东华软件	42.95	315.42	1.99
002230	科大讯飞	51.3	395.43	2.50	002465	海格通信	41.5	292.44	1.85

涨幅前 5 名样本股

代码	简称	收盘	涨幅%	贡献点数
002312	三泰控股	90.75	95.33	69.70
002183	怡亚通	73.15	94.55	149.23
002405	四维图新	70.00	86.60	107.05
002273	水晶光电	43.12	67.20	30.38
002104	恒宝股份	35.50	67.06	50.26

跌幅前 5 名样本股

代码	简称	收盘	涨幅%	贡献点数
002146	荣盛发展	20.55	-12.81	-11.54
002051	中工国际	33.13	-6.25	-4.66
002155	湖南黄金	13.52	-4.65	-0.59
002142	宁波银行	18.89	-2.68	-4.21
002673	西部证券	62.74	-1.04	-1.80

行业分布 (2015.05.31)

行业	家数	权重 (%)	贡献点数
信息技术	27	32.58	845.24
工业	16	15.19	369.76
可选消费	12	13.68	367.78
医药卫生	15	11.91	215.24
原材料	11	10.12	211.66
金融地产	8	5.99	76.25
主要消费	5	5.76	-1.58
电信业务	5	3.74	94.12
能源	1	1.03	16.47
公用事业	/	/	/
总计	100	100	2194.93

市场分布 (2015.05.31)

市场	家数	权重 (%)	贡献点数
深市主板	/	/	/
深市中小板	100	100.00	2194.93
创业板	/	/	/
沪市	/	/	/
总计	100	100	2194.93

样本股自由流通市值分布 (2015.05.31)

最大	最小	均值	中值
710.02	48.84	158.14	124.02

399006 创业板指数

本月收盘	本月涨幅	本月涨跌(点)	成交量	成交金额	样本数
3542.84	23.97%	684.95	351.92	15295.38	100
总市值	自由流通市值	总市值覆盖率	静态 PE	滚动 PE	股息率
26088.17	12464.15	42.00%	125	123.12	0.17%

注：“成交量”单位为“亿股”，“成交金额”、“总市值”、“自由流通市值”单位为“亿元”，下同。

权重前 10 名样本股

代码	简称	收盘	自由流通市值	权重%	代码	简称	收盘	自由流通市值	权重%
300059	东方财富	74.29	779.15	6.25	300070	碧水源	58.3	308.31	2.47
300104	乐视网	67.82	506.52	4.06	300017	网宿科技	54.61	228.37	1.83
300024	机器人	103.5	470.86	3.78	300253	卫宁软件	71.07	226.60	1.82
300168	万达信息	140.34	425.13	3.41	300124	汇川技术	61.75	223.20	1.79
300027	华谊兄弟	42.14	322.74	2.59	300058	蓝色光标	39.44	209.56	1.68

涨幅前 5 名样本股

代码	简称	收盘	涨幅%	贡献点数
300001	特锐德	65.60	236.41	24.24
300271	华宇软件	64.77	124.82	20.42
300096	易联众	39.55	95.21	16.39
300010	立思辰	47.26	90.68	20.71
300024	机器人	103.50	78.05	58.67

跌幅前 5 名样本股

代码	简称	收盘	涨幅%	贡献点数
300033	同花顺	94.88	-12.70	-6.88
300059	东方财富	74.29	-11.51	-28.80
300295	三六五网	153.86	-7.71	-1.66
300171	东富龙	74.00	-4.70	-1.10
300113	顺网科技	57.80	-4.30	-1.02

行业分布 (2015.05.31)

行业	家数	权重 (%)	贡献点数
信息技术	37	45.20	256.45
工业	20	20.05	186.20
医药卫生	18	14.03	98.03
可选消费	12	12.50	94.93
电信业务	6	3.83	23.95
原材料	5	2.94	20.06
主要消费	1	0.86	2.89
能源	1	0.59	2.42
金融地产	/	/	/
公用事业	/	/	/
总计	100	100	684.95

市场分布 (2015.05.31)

市场	家数	权重 (%)	贡献点数
深市主板	/	/	/
中小板	/	/	/
创业板	100	100.00	684.95
沪市	/	/	/
总计	100	100.00	684.95

样本股自由流通市值分布 (2015.05.31)

最大	最小	均值	中值
779.15	31.18	124.64	97.22

399330 深证 100 指数

本月收盘	本月涨幅	本月涨跌(点)	成交量	成交金额	样本数
5443.59	9.11%	454.69	1904.89	34601.95	100
总市值	自由流通市值	总市值覆盖率	静态 PE	滚动 PE	股息率
60355.55	28883.09	22.74%	34.59	34.13	0.75%

注：“成交量”单位为“亿股”，“成交金额”、“总市值”、“自由流通市值”单位为“亿元”，下同。

权重前 10 名样本股

代码	简称	收盘	自由流通市值	权重%	代码	简称	收盘	自由流通市值	权重%
000651	格力电器	62.21	1346.60	4.66	000776	广发证券	25.83	707.16	2.45
000002	万科A	14.35	1151.79	3.99	000166	申万宏源	18.7	608.63	2.11
000001	平安银行	15.32	912.05	3.16	000783	长江证券	17.25	563.84	1.95
000333	美的集团	37	715.59	2.48	002415	海康威视	45.36	563.23	1.95
002024	苏宁云商	18.53	710.02	2.46	000063	中兴通讯	30.88	538.27	1.86

涨幅前 5 名样本股

代码	简称	收盘	涨幅%	贡献点数
002405	四维图新	70.00	86.60	29.08
300024	机器人	103.50	78.05	38.90
002456	欧菲光	45.86	50.31	16.68
000917	电广传媒	42.89	49.44	28.13
002024	苏宁云商	18.53	41.82	39.21

跌幅前 5 名样本股

代码	简称	收盘	涨幅%	贡献点数
000625	长安汽车	21.55	-14.48	-13.33
002146	荣盛发展	20.55	-12.81	-3.13
000009	中国宝安	20.22	-9.65	-4.93
000728	国元证券	33.00	-8.67	-5.91
000402	金融街	12.65	-8.63	-4.58

行业分布 (2015.05.31)

行业	家数	权重 (%)	贡献点数
金融地产	16	22.62	150.54
可选消费	16	22.00	-49.93
工业	17	16.45	146.72
信息技术	13	12.65	103.90
原材料	12	8.14	31.56
主要消费	11	7.34	20.50
医药卫生	9	6.07	35.75
电信业务	2	2.88	14.39
能源	3	1.25	2.77
公用事业	1	0.61	-1.52
总计	100	100	454.70

市场分布 (2015.05.31)

市场	家数	权重 (%)	贡献点数
深市主板	59	64.06	92.43
中小板	32	26.83	263.42
创业板	9	9.12	98.85
沪市	/	/	/
总计	100	100	454.70

样本股自由流通市值分布 (2015.05.31)

最大	最小	均值	中值
1346.60	48.84	288.83	219.93

399311 国证 1000 指数

本月收盘	本月涨幅	本月涨跌(点)	成交量	成交金额	样本数
5696.62	7.71%	407.68	12799.65	213869.37	1000
总市值	自由流通市值	总市值覆盖率	静态 PE	滚动 PE	股息率
440364.51	172068.12	70.50%	25	24.85	1.22%

注：“成交量”单位为“亿股”，“成交金额”、“总市值”、“自由流通市值”单位为“亿元”，下同。

权重前 10 名样本股

代码	简称	收盘	自由流通市值	权重%	代码	简称	收盘	自由流通市值	权重%
601318	中国平安	85.44	4216.44	2.45	601166	兴业银行	17.99	1926.15	1.12
600036	招商银行	18.07	2162.81	1.26	600000	浦发银行	17.04	1774.25	1.03
600016	民生银行	10.02	2127.24	1.24	601328	交通银行	6.82	1370.19	0.80
600030	中信证券	30.37	2102.16	1.22	000651	格力电器	62.21	1346.60	0.78
600837	海通证券	25.76	1975.20	1.15	601668	中国建筑	9.31	1214.46	0.71

涨幅前 5 名样本股

代码	简称	收盘	涨幅%	贡献点数
600503	华丽家族	27.31	310.68	6.50
601608	中信重工	26.30	307.75	4.77
002276	万马股份	36.70	106.53	2.71
600862	南通科技	37.78	105.77	2.55
000883	湖北能源	13.03	102.64	3.92

跌幅前 5 名样本股

代码	简称	收盘	涨幅%	贡献点数
600970	中材国际	17.73	-100.00	-0.01
600597	光明乳业	19.56	-100.00	-0.05
600209	罗顿发展	10.35	-100.00	0.00
601618	中国中冶	8.60	-22.03	-3.18
000401	冀东水泥	16.30	-21.63	-0.63

行业分布 (2015.05.31)

行业	家数	权重 (%)	贡献点数
金融地产	113	26.29	-50.51
工业	205	19.58	90.63
可选消费	126	11.67	127.12
原材料	136	11.34	78.03
信息技术	157	10.34	54.80
医药卫生	89	6.52	52.20
主要消费	65	5.29	25.93
公用事业	36	3.50	13.38
能源	45	3.02	-2.21
电信业务	28	2.45	21.21
总计	1000	100	410.59

市场分布 (2015.05.31)

市场	家数	权重 (%)	贡献点数
深市主板	204	18.41	72.17
中小板	214	13.79	158.11
创业板	73	5.75	53.81
沪市	509	62.06	126.50
总计	1000	100	410.59

样本股自由流通市值分布 (2015.05.31)

最大	最小	均值	中值
4216.44	14.76	172.07	102.44

指数发布动态

本月无新指数发布。

免责声明

本报告基于已公开的数据和文字资料，我公司力求但不保证相关资料的准确性及完整性。报告中的信息或观点仅供参考，均不构成对任何投资工具的买卖建议或投资策略的行为依据。

我公司保留报告所有版权，未经书面许可任何机构和个人不得以任何形式翻版、复制、刊登、发表或引用。

深圳证券信息公司指数事业部

地址：广东省深圳市福田区香梅路1061号中投国际商务中心B1栋10F

邮编：518040

电话：(+86) 755-82793031

传真：(+86) 755-83243723

电邮：index@cninfo.com.cn

网址：www.cnindex.com.cn