

## 2015年8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8月份，市场呈现普遍下跌行情。核心指数中，国证1000指数表现最佳，本月下跌-12.84%。

行业指数方面，深证行业指数中，深证公用事业指数单月跌幅为-10.04%，在深证行业指数中跌幅最小。国证行业指数中，国证电力指数表现最好，单月下跌-5.25%。

主题指数方面，深证系列主题指数中，深证消费50指数表现较优，跌幅为-9.55%。国证主题系列指数中，国证商业连锁指数表现最佳，跌幅为-6.74%。

人民币系列指数中，人民币指数和人民币实际指数本月都下跌了2.73%，而近一年涨幅则分别为8.75%和8.53%。

深证系列指数		2015年8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
CN5061	深证GDP对冲	2.48%	6.82%	18.90%	12.88%

  

国证系列指数		2015年8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
399299	深信中低信用	1.10%	2.19%	4.80%	9.94%

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
399330	深证 100	-13.75%	-32.07%	-5.18%	37.73%	43.47%
399007	深证 300	-14.44%	-34.12%	0.03%	40.54%	44.04%
399001	深证成指	-14.75%	-34.48%	-10.28%	34.53%	44.51%
399011	深证 1000	-14.76%	-35.49%	5.69%	44.10%	43.78%
399010	深证 700	-15.20%	-37.30%	14.32%	49.09%	44.84%
399015	中小创新	-14.80%	-38.19%	15.38%	48.67%	45.12%
399009	深证 200	-15.39%	-36.70%	8.06%	44.00%	46.77%
399008	中小板 300	-14.95%	-36.03%	10.27%	38.78%	44.70%
399624	中创 400	-16.85%	-39.53%	12.47%	42.40%	46.19%
399625	中创 500	-16.81%	-38.48%	9.20%	41.01%	46.16%
399005	中小板指	-14.43%	-34.99%	7.58%	37.10%	45.28%
399611	中创 100R	-16.76%	-36.84%	5.46%	39.80%	47.39%
399612	中创 100	-16.76%	-36.98%	5.02%	39.19%	47.40%
399012	创业板 300	-19.69%	-43.04%	11.39%	49.69%	50.25%
399006	创业板指	-21.38%	-43.64%	3.57%	40.18%	52.30%

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
399310	国证 40	-9.91%	-25.68%	-9.41%	37.93%	44.15%
399313	巨潮 100	-10.81%	-29.52%	-9.56%	38.99%	43.80%
399314	巨潮大盘	-12.05%	-30.80%	-7.93%	42.49%	43.70%
399312	国证 300	-11.99%	-30.90%	-5.62%	45.73%	43.50%
399400	大中盘	-12.39%	-31.71%	-4.30%	44.41%	43.56%
399311	国证 1000	-12.84%	-32.31%	-1.27%	45.91%	43.60%
399316	巨潮小盘	-14.46%	-34.44%	10.93%	50.89%	47.33%
399401	中小盘	-13.77%	-34.06%	7.78%	49.60%	47.37%
399315	巨潮中盘	-13.14%	-33.74%	4.97%	48.38%	47.67%
399303	国证 2000	-13.16%	-36.93%	18.41%	56.17%	46.37%

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	总市值	静态	滚动	股息率	ROE
			市值	覆盖率	PE	PE		
399001	深证成指	99782.58	47527.10	57.36%	34.98	34.45	0.83%	9.83%
399005	中小板指	26187.80	11331.26	34.66%	40.08	38.87	0.69%	11.53%
399006	创业板指	15817.43	7548.21	43.83%	69.69	68.59	0.32%	10.52%
399330	深证 100	43866.62	21785.98	25.22%	24.33	23.89	1.23%	11.58%
399007	深证 300	77593.80	37423.43	44.60%	31.28	30.78	0.93%	10.32%
399009	深证 200	33727.18	15637.45	19.39%	49.82	49.28	0.54%	8.01%
399010	深证 700	59689.07	26697.84	34.31%	64.13	63.10	0.46%	6.62%
399011	深证 1000	137282.87	64121.28	78.91%	40.24	39.59	0.73%	8.96%
399008	中小板 300	47719.37	20417.39	63.16%	48.50	47.22	0.61%	9.51%
399012	创业板 300	28333.37	13112.51	78.50%	77.01	76.22	0.32%	8.39%
399015	中小创新	37500.29	16594.17	21.56%	67.08	65.73	0.44%	6.15%
399612	中创 100	28995.24	13150.01	25.97%	41.55	40.43	0.66%	12.00%
399625	中创 500	70391.33	31253.24	63.05%	53.83	52.42	0.54%	9.32%
399624	中创 400	41396.09	18103.23	37.08%	67.87	66.14	0.46%	7.42%
399310	国证 50	123574.46	37769.95	28.33%	9.74	9.79	3.25%	13.46%
399313	巨潮 100	154084.02	50760.75	35.33%	10.93	10.94	2.88%	13.19%
399312	国证 300	222330.84	80938.96	50.98%	13.96	13.85	2.28%	12.26%
399311	国证 1000	320976.93	125319.49	73.59%	17.96	17.86	1.77%	11.26%
399314	巨潮大盘	193288.97	68433.08	44.32%	12.72	12.64	2.48%	12.71%
399315	巨潮中盘	68410.47	30002.38	15.69%	43.39	43.68	0.76%	7.04%
399316	巨潮小盘	59277.48	26884.03	13.59%	53.60	53.11	0.60%	6.55%
399400	大中盘	261699.44	98435.46	60.00%	15.61	15.53	2.03%	11.82%
399401	中小盘	127687.96	56886.41	29.28%	47.59	47.60	0.68%	6.83%
399303	国证 2000	92915.63	40335.78	21.30%	78.73	79.21	0.45%	5.14%

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	-10.38%	-33.74%	-3.41%	24.93%	48.59%
399614	深证材料指数	-13.20%	-32.40%	8.75%	43.11%	41.96%
399615	深证工业指数	-14.33%	-34.77%	11.46%	52.52%	45.56%
399616	深证可选消费	-12.20%	-31.10%	7.68%	44.52%	42.10%
399617	深证主要消费	-13.77%	-27.83%	6.76%	24.04%	44.35%
399618	深证医药卫生	-13.16%	-29.73%	12.21%	36.34%	44.92%
399619	深证金融地产	-15.52%	-34.51%	-18.03%	50.48%	47.19%
399620	深证信息技术	-20.40%	-45.52%	-2.45%	35.93%	50.49%
399621	深证电信指数	-19.05%	-38.07%	6.91%	41.72%	51.87%
399622	深证公用事业	-10.04%	-31.22%	8.67%	82.29%	53.65%
399674	深 A 医药卫生	-14.07%	-33.00%	13.72%	36.57%	45.45%
399675	深 A 软件与互联网	-23.74%	-52.66%	-5.02%	61.55%	58.38%

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	-13.84%	-28.42%	-6.14%	14.59%	48.08%
399382	国证 1000 材料	-12.81%	-35.09%	-4.08%	31.57%	48.56%
399383	国证 1000 工业	-11.83%	-34.33%	9.33%	73.27%	50.85%
399384	国证 1000 可选	-10.89%	-29.77%	5.16%	41.36%	44.95%
399385	国证 1000 消费	-9.21%	-24.04%	7.40%	27.61%	43.76%
399386	国证 1000 医药	-12.86%	-28.94%	12.04%	37.14%	44.61%
399387	国证 1000 金融	-12.37%	-28.47%	-13.12%	46.90%	44.73%
399388	国证 1000 信息	-20.28%	-45.54%	-3.78%	37.08%	51.87%
CN5110	国证 1000 电信	-15.30%	-38.66%	2.65%	43.11%	55.83%
399390	国证 1000 公用	-7.93%	-23.11%	13.92%	77.62%	51.43%
399431	国证银行指数	-6.28%	-14.70%	1.04%	45.23%	44.78%
399432	国证汽车指数	-10.90%	-31.26%	-7.40%	22.40%	46.41%
399433	国证交运指数	-8.18%	-22.89%	20.65%	103.85%	53.52%
399434	国证传媒指数	-11.34%	-31.95%	6.31%	33.30%	46.62%
399435	国证农牧指数	-13.38%	-28.87%	14.78%	41.06%	53.30%
399436	国证煤炭指数	-12.51%	-28.32%	-2.81%	25.25%	55.11%
399437	国证证券指数	-25.78%	-49.66%	-42.41%	36.37%	60.49%
399438	国证电力指数	-5.25%	-16.20%	27.01%	94.73%	50.45%
399439	国证油气指数	-18.16%	-32.36%	-14.86%	4.24%	47.09%
399440	国证钢铁指数	-12.28%	-25.43%	10.82%	84.51%	48.24%

CN5073	国证能源指数	-13.72%	-28.47%	-5.11%	17.57%	48.98%
CN5074	国证非银指数	-19.23%	-42.12%	-33.79%	40.37%	54.41%
CN5075	国证软件指数	-24.49%	-53.32%	-13.67%	52.77%	62.27%
CN5076	国证生科指数	-13.54%	-27.22%	31.29%	61.47%	44.40%
CN5077	国证电影指数	-15.13%	-30.32%	11.58%	41.03%	59.62%
CN5078	国证家电指数	-13.81%	-31.55%	1.78%	42.43%	51.25%
CN5079	国证中药指数	-12.99%	-29.74%	7.65%	32.03%	52.31%
CN5080	国证建材指数	-7.55%	-32.07%	-1.13%	36.09%	50.50%
CN5081	国证白酒指数	-8.04%	-17.89%	7.49%	29.43%	46.11%
CN5082	国证航天指数	-17.22%	-33.00%	19.28%	73.82%	73.43%
CN5083	国证半导指数	-19.23%	-46.91%	-4.36%	14.42%	58.90%
CN5084	电信服务指数	-10.64%	-39.57%	-1.81%	54.75%	57.93%
CN5085	服装纺织指数	-6.56%	-26.05%	32.72%	89.90%	50.65%
CN5086	工业服务指数	-11.26%	-33.56%	6.06%	83.70%	52.78%
CN5087	工业用品指数	-13.99%	-38.01%	10.12%	57.64%	54.02%
CN5088	国证公用指数	-7.21%	-21.37%	17.21%	81.27%	51.32%
CN5089	国证材料指数	-12.22%	-35.98%	-4.85%	29.05%	50.08%
CN5090	国证化工指数	-13.72%	-33.72%	8.79%	44.19%	48.88%
CN5091	电脑硬件指数	-16.96%	-38.11%	8.44%	31.33%	49.50%
CN5092	国证家用指数	-15.04%	-38.50%	-8.80%	5.19%	48.91%
CN5093	国证零售指数	-8.35%	-33.52%	15.66%	61.95%	54.02%
CN5094	耐用消费指数	-13.93%	-29.92%	8.47%	52.44%	47.08%
CN5095	食品零售指数	-10.54%	-33.24%	7.01%	38.61%	54.00%
CN5096	国证通信指数	-18.38%	-40.16%	5.68%	41.54%	54.83%
CN5097	消费服务指数	-17.33%	-38.79%	2.26%	32.73%	49.24%
CN5098	国证医疗指数	-21.47%	-42.76%	2.46%	25.33%	58.98%
CN5099	国证制药指数	-11.92%	-29.97%	10.07%	33.70%	48.91%
CN5100	白色家电指数	-13.45%	-31.74%	-4.51%	31.11%	53.81%
CN5101	国证百货指数	-6.77%	-28.26%	21.39%	64.54%	50.64%
CN5102	国证空运指数	-27.20%	-22.98%	26.97%	141.33%	71.58%
CN5103	网络软件指数	-28.65%	-53.33%	-19.20%	65.56%	65.50%
CN5104	建筑工程指数	-12.80%	-35.43%	2.11%	106.10%	61.63%
CN5105	路桥港口指数	-6.14%	-28.20%	6.41%	74.49%	58.41%
CN5106	酒店餐饮指数	-16.37%	-29.82%	17.76%	52.51%	46.69%
CN5107	国证水务指数	-13.07%	-36.93%	-21.07%	31.07%	59.56%
CN5108	国证机械指数	-14.60%	-38.97%	4.34%	41.02%	55.97%

## 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	-15.51%	-32.84%	-1.29%	32.03%	43.19%
399348	深证 300 价值	-12.28%	-30.45%	-3.83%	38.36%	44.39%
399628	深证 700 成长	-17.14%	-40.12%	12.59%	49.79%	45.49%
399629	深证 700 价值	-14.26%	-33.42%	16.42%	53.42%	47.56%
399630	深证 1000 成长	-16.31%	-36.19%	3.69%	38.99%	43.59%
399631	深证 1000 价值	-12.92%	-31.37%	3.11%	46.75%	44.17%
399602	中小 300 成长	-15.48%	-34.22%	12.25%	42.13%	42.99%
399604	中小 300 价值	-14.85%	-35.71%	3.92%	36.67%	47.14%
399667	创业 300 成长	-21.00%	-43.40%	2.86%	40.51%	52.74%
399668	创业 300 价值	-20.93%	-43.94%	15.33%	45.37%	50.60%
399626	中创 500 成长	-18.03%	-37.94%	5.86%	39.08%	46.76%
399627	中创 500 价值	-15.42%	-36.23%	6.29%	38.77%	47.11%

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	-12.59%	-30.10%	1.50%	39.37%	40.56%
399371	国证 1000 价值	-9.77%	-25.86%	1.26%	54.86%	43.62%
399372	1000 大盘成长	-10.53%	-25.98%	-2.39%	37.17%	40.73%
399373	1000 大盘价值	-8.32%	-23.70%	-2.98%	50.57%	44.00%
399374	1000 中盘成长	-13.58%	-33.87%	3.42%	32.94%	44.69%
399375	1000 中盘价值	-11.54%	-26.79%	11.86%	70.10%	50.58%
399376	1000 小盘成长	-17.00%	-36.49%	10.64%	48.92%	46.79%
399377	1000 小盘价值	-13.22%	-32.80%	7.12%	52.86%	52.17%

## 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
399646	深证消费 50	-9.55%	-27.15%	4.82%	37.05%	42.96%
399637	深证地产指数	-9.94%	-25.48%	12.75%	68.17%	45.76%
399671	深证防御 50	-10.45%	-24.82%	11.64%	39.50%	41.33%
399328	深证治理指数	-10.48%	-25.44%	-0.21%	35.99%	42.53%
399341	深证责任指数	-11.35%	-28.74%	-0.53%	37.58%	44.56%
399335	深证央企指数	-11.38%	-25.93%	4.45%	51.80%	42.02%

399324	深证红利指数	-11.78%	-29.28%	-7.71%	42.16%	45.99%
399651	中小责任指数	-11.85%	-28.91%	10.32%	49.12%	45.21%
399638	深证环保指数	-11.85%	-33.00%	8.43%	36.47%	47.16%
399647	深证医药 50	-12.79%	-28.20%	13.97%	36.97%	44.01%
399653	深证龙头指数	-12.87%	-28.90%	-0.10%	41.11%	42.35%
399013	深市精选指数	-13.73%	-32.30%	1.29%	40.31%	42.63%
399650	中小治理指数	-13.83%	-33.19%	6.60%	38.47%	44.92%
399669	深证农业指数	-14.08%	-29.03%	6.41%	32.39%	46.11%
399639	深证大宗商品	-14.13%	-28.65%	2.27%	36.04%	45.77%
399649	中小红利指数	-14.51%	-35.56%	8.12%	37.91%	45.33%
399670	深证周期 50	-14.89%	-34.05%	-14.68%	30.28%	44.89%
399654	深证文化指数	-14.98%	-32.65%	12.97%	65.27%	41.23%
399332	深证创新指数	-15.01%	-33.99%	-4.80%	31.79%	48.70%
399642	中小新兴产业	-15.22%	-37.79%	7.90%	34.48%	47.41%
399636	深证装备指数	-15.47%	-34.47%	6.20%	41.53%	50.23%
399337	深证民营指数	-16.27%	-36.23%	-1.86%	36.10%	46.10%
399641	深证新兴产业	-16.49%	-37.83%	3.32%	39.50%	47.92%
399608	深证科技 100	-18.26%	-39.37%	6.49%	33.79%	50.03%
399610	深证 TMT50	-18.31%	-39.86%	2.05%	42.98%	48.65%
399339	深证科技指数	-18.35%	-39.91%	1.26%	35.04%	50.07%
399643	创业新兴产业	-21.26%	-43.53%	7.01%	47.18%	51.63%
399678	深证次新股指数	-24.14%	-47.89%	7.57%	36.14%	48.38%
399652	中创高新指数	-24.97%	-47.18%	5.39%	41.92%	54.41%

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
399361	国证商业连锁	-6.74%	-29.83%	14.48%	54.18%	52.29%
399353	国证物流指数	-7.96%	-23.82%	19.12%	95.72%	50.83%
399320	国证服务指数	-8.44%	-24.47%	16.88%	79.02%	47.67%
399365	国证农业指数	-8.95%	-24.01%	5.56%	27.67%	43.44%
399359	国证基建指数	-9.09%	-28.10%	8.70%	81.32%	53.19%
399322	国证治理指数	-9.45%	-23.25%	-3.04%	39.15%	40.61%
399396	国证食品指数	-9.45%	-23.28%	6.83%	24.64%	41.27%
399321	国证红利指数	-9.57%	-25.04%	-7.77%	40.44%	43.97%
399403	国证防御 100	-10.17%	-28.34%	5.78%	32.88%	43.44%
399412	国证新能指数	-11.83%	-36.67%	3.80%	28.86%	47.78%
399395	国证有色指数	-11.95%	-40.33%	-15.08%	10.63%	51.97%
399367	国证地产指数	-12.46%	-25.25%	4.53%	63.83%	47.36%
399393	国证地产指数	-12.69%	-27.60%	2.08%	64.74%	47.59%
399360	国证装备指数	-13.01%	-37.32%	7.22%	58.89%	55.35%
399319	国证资源优势	-13.27%	-34.76%	-10.41%	18.60%	50.06%

## Index Statistics Report August 2015

399394	国证医药指数	-13.36%	-29.34%	13.48%	35.64%	45.87%
399366	国证大宗商品	-13.58%	-33.11%	-8.09%	23.81%	49.57%
399362	国证民营指数	-14.22%	-33.74%	-0.52%	42.47%	42.92%
399441	国证生物医药	-14.62%	-26.68%	31.17%	63.01%	41.80%
399389	国证 1000 电信	-14.92%	-40.03%	7.50%	49.87%	50.95%
399392	国证新兴产业	-15.00%	-36.93%	6.53%	45.79%	49.91%
399418	国证国家安全	-15.01%	-36.92%	8.00%	49.44%	51.22%
399402	国证周期 100	-15.03%	-36.04%	-21.32%	30.78%	46.93%
399428	国证定向增发	-15.32%	-38.30%	12.80%	67.07%	57.83%
399419	国证高铁指数	-15.53%	-44.21%	-0.91%	87.28%	53.12%
399368	国证航天军工	-16.93%	-34.56%	20.18%	85.67%	62.21%
399420	国证保证指数	-21.15%	-44.98%	-37.34%	41.63%	55.11%
399363	国证科技指数	-21.21%	-46.66%	-6.66%	28.66%	50.42%

## 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	-10.76%	-28.49%	-7.19%	43.34%	42.39%
399355	长三角指数	-11.83%	-32.58%	-10.82%	46.19%	47.16%
399356	珠三角指数	-12.36%	-29.81%	-8.81%	43.93%	43.85%
399357	环渤海指数	-10.76%	-25.29%	-2.52%	44.99%	42.70%
CN6001	安徽指数	-12.38%	-33.85%	8.07%	48.87%	44.81%
CN6004	甘肃指数	-12.45%	-34.23%	-2.98%	28.33%	51.61%
CN6029	云南指数	-12.69%	-31.55%	-2.43%	33.73%	44.01%
CN6005	广东指数	-12.75%	-31.73%	4.03%	52.65%	41.10%
CN6028	新疆指数	-12.91%	-34.13%	-1.79%	40.19%	49.85%
CN6009	河北指数	-15.33%	-24.40%	8.73%	56.32%	43.26%
CN6030	浙江指数	-15.36%	-37.55%	11.21%	48.18%	46.37%
CN6020	青海指数	-15.61%	-42.70%	-16.60%	12.58%	52.35%
CN6023	陕西指数	-15.66%	-35.54%	9.06%	64.66%	55.44%
CN6006	广西指数	-22.10%	-36.84%	7.71%	50.94%	46.37%

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	-13.31%	-31.92%	-0.48%	50.60%	43.52%
399633	深证 300 等权	-14.69%	-35.21%	4.65%	47.45%	45.48%
399634	中小板等权指数	-15.28%	-35.55%	9.56%	39.96%	45.84%
399635	创业板等权指数	-19.92%	-42.70%	7.18%	38.81%	50.28%
399645	深证 100 低波	-10.37%	-24.69%	4.42%	64.93%	40.98%
399655	深证绩效指数	-14.12%	-33.52%	7.33%	32.24%	47.82%
399656	深证 100 绩效	-11.94%	-30.21%	1.74%	38.06%	44.46%
399657	深证 300 绩效	-14.88%	-34.58%	5.12%	40.85%	45.91%
399658	中小板指绩效	-15.04%	-35.79%	8.45%	34.77%	46.21%
399659	深证成份等权	-14.97%	-34.05%	-4.63%	52.27%	45.67%
399660	中创 100 等权	-16.70%	-36.51%	5.92%	40.73%	46.79%
399661	深证 300 低波	-11.89%	-27.80%	6.40%	61.94%	42.12%
399662	深证 300 高贝	-16.73%	-39.96%	2.28%	42.67%	50.53%
399663	中小 300 低波	-13.96%	-34.07%	11.25%	40.84%	43.62%
399664	中小 300 高贝	-13.86%	-38.33%	16.83%	49.22%	49.12%
399665	中创 500 低波	-14.45%	-34.73%	13.59%	43.10%	44.00%
399666	中创 500 高贝	-16.86%	-40.89%	11.66%	45.61%	48.78%
399672	深红利 50 指数	-12.33%	-25.79%	13.14%	53.56%	46.37%
399673	创业板 50 指数	-22.47%	-44.44%	-0.54%	38.62%	55.59%
399676	深 A 医药卫生等权	-13.28%	-35.59%	17.59%	41.29%	47.31%
399677	深 A 软件与互联网等权	-20.91%	-52.09%	3.90%	75.13%	58.54%

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	-12.44%	-30.86%	2.83%	30.38%	43.92%
399404	大盘低波	-9.10%	-23.82%	3.24%	72.86%	44.81%
399405	大盘高贝	-15.05%	-36.09%	-17.14%	46.48%	47.25%
399406	中盘低波	-9.38%	-23.37%	17.30%	89.71%	44.32%
399407	中盘高贝	-14.45%	-38.88%	1.91%	34.52%	53.53%
399408	小盘低波	-11.31%	-29.95%	13.40%	63.59%	49.42%
399409	小盘高贝	-15.65%	-39.40%	5.44%	41.09%	49.86%
399411	红利 100	-11.63%	-26.56%	4.73%	51.44%	44.71%

399427	专利领先	-16.09%	-35.85%	11.01%	62.30%	47.93%
--------	------	---------	---------	--------	--------	--------

## 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	-14.56%	-34.56%	3.06%	35.96%	43.51%
399358	泰达环保指数	-12.23%	-33.04%	1.07%	30.39%	46.94%
399364	中金龙头消费	-9.92%	-26.49%	4.87%	33.71%	43.66%
399369	CBN-兴业责任	-11.71%	-31.23%	-6.06%	37.27%	45.45%
399378	南方低碳指数	-11.22%	-27.33%	2.43%	51.22%	44.93%
399391	国证投资时钟	-8.94%	-27.12%	1.51%	39.08%	44.07%
399644	深证投资时钟	-12.06%	-30.37%	-4.92%	29.70%	45.11%
399648	深证 GDP100	-11.21%	-26.30%	14.80%	59.13%	38.33%
399397	华侨城文化	-15.42%	-34.76%	5.06%	45.46%	45.23%
399399	中经 GDP 指数	-14.10%	-31.00%	-3.29%	46.82%	43.57%
399350	国元皖江 30	-12.23%	-31.69%	4.51%	51.31%	42.36%
399410	苏州率先指数	-19.83%	-42.03%	-3.12%	49.79%	46.57%
CN5061	深证 GDP 对冲	2.48%	6.82%	18.90%	12.88%	10.07%
CN5062	中经 GDP 对冲	-2.52%	-0.83%	2.40%	1.16%	6.56%
399415	大数据 100 指数	-17.98%	-38.33%	17.79%	51.90%	51.43%
399416	大数据 300 指数	-14.30%	-32.61%	-3.54%	7.12%	45.11%
399429	新丝路指数	-14.00%	-34.74%	2.05%	38.51%	51.16%
399423	中关村 50 指数	-18.45%	-40.26%	0.87%	42.37%	52.87%
CN5069	中关村 A 指	-17.46%	-41.41%	6.49%	54.76%	53.52%

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	-11.82%	-30.22%	-4.54%	27.37%	42.66%
399551	央视创新指数	-16.47%	-39.94%	0.36%	34.67%	51.77%
399552	央视成长指数	-9.80%	-27.74%	-2.26%	34.96%	41.44%
399553	央视回报指数	-13.09%	-33.04%	-4.19%	20.43%	44.58%
399554	央视治理指数	-11.85%	-27.84%	-5.68%	31.97%	39.87%
399555	央视责任指数	-9.40%	-22.29%	-3.58%	37.21%	41.55%
399556	央视生态指数	-12.70%	-32.30%	7.14%	34.72%	44.88%
399557	央视文化指数	-16.66%	-36.88%	3.73%	45.02%	46.34%

## 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	-2.73%	-1.75%	-0.12%	8.75%	5.16%
CNYR	人民币实际指数	-2.73%	-1.43%	0.60%	8.53%	5.31%

## 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	-8.80%	-44.19%	-29.52%	0.36%	57.85%
399307	深证转债指数	-9.53%	-41.27%	-3.02%	42.01%	57.34%
399298	深信中高信用	0.78%	2.08%	4.43%	9.09%	1.07%
399299	深信中低信用	1.10%	2.19%	4.80%	9.94%	0.97%
399301	深证信用债	0.95%	2.20%	4.53%	9.53%	0.85%
399302	深证公司债	0.96%	2.15%	4.56%	9.65%	0.85%

## 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	-11.80%	-32.32%	-9.02%	26.60%	35.12%
399305	基金指数	-9.54%	-29.93%	-8.78%	15.97%	50.63%
399306	深证 ETF	-14.82%	-33.11%	-7.11%	37.25%	50.05%
399379	国证基金	-11.56%	-30.88%	-8.06%	31.78%	36.90%
399380	国证 ETF	-12.17%	-29.68%	-5.73%	39.89%	45.40%
CN6070	中国股基指数	-13.72%	-37.42%	-1.94%	28.70%	46.71%
CN6071	中国混基指数	-4.60%	-21.63%	14.28%	45.16%	30.96%
CN6072	中国债基指数	0.08%	-1.21%	6.23%	18.46%	5.26%

**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
10549.16	-14.75%	-1825.09	3210.63	50883.68	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
99782.58	47527.10	57.36%	34.98	34.45	0.83%

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%
000002	万科 A	13.80	1112.44	2.34	002024	苏宁云商	14.41	552.15	1.16
000651	格力电器	18.45	798.74	1.68	000917	电广传媒	42.83	453.74	0.95
000725	京东方 A	3.07	682.06	1.44	002183	怡亚通	73.15	453.06	0.95
000001	平安银行	11.07	659.03	1.39	000858	五粮液	25.73	428.97	0.90
000333	美的集团	28.79	555.56	1.17	002415	海康威视	32.39	402.18	0.85

**涨幅前 5 名样本股**

代码	简称	收盘	涨幅%	贡献点数
000601	韶能股份	12.6	49.87	7.69
300216	千山药机	47.74	24.97	4.99
000875	吉电股份	12.4	22.41	5.39
000666	经纬纺机	17.7	21.48	1.98
002151	北斗星通	54.26	19.94	2.12

**跌幅前 5 名样本股**

代码	简称	收盘	涨幅%	贡献点数
002268	卫士通	41.37	-51.21	-21.27
300228	富瑞特装	39.24	-46.71	-6.65
002477	雏鹰农牧	12.45	-44.98	-8.64
300178	腾邦国际	18.85	-43.97	-8.76
300020	银江股份	14.8	-43.83	-10.14

**行业分布 (2015.8.31)**

行业	家数	权重 (%)	贡献点数
信息技术	96	19.11	-505.20
工业	100	16.91	-297.49
可选消费	63	16.41	-239.49
金融地产	39	13.31	-242.85
原材料	77	11.96	-192.46
医药卫生	49	8.90	-147.01
主要消费	29	5.86	-84.04
电信业务	23	3.67	-78.68
公用事业	13	2.30	-23.10
能源	11	1.58	-14.77
总计	500	100	-1825.09

**市场分布 (2015.8.31)**

市场	家数	权重 (%)	贡献点数
深市主板	194	49.18	-709.20
深市中小板	212	35.49	-679.78
深市创业板	94	15.33	-436.11
沪市	/	/	/
总计	500	100	-1825.09

**样本股自由流通市值分布 (2015.8.31)**

最大	最小	均值	中值
1112.44	14.31	95.05	62.74

**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
7133.33	-14.43%	-1202.79	563.51	11430.26	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
26187.80	11331.26	34.66%	40.08	38.87	0.69%

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	14.41	552.15	4.87	002202	金风科技	15.40	228.41	2.02
002183	怡亚通	73.15	453.06	4.00	002230	科大讯飞	27.63	219.38	1.94
002415	海康威视	32.39	402.18	3.55	002304	洋河股份	55.59	212.60	1.88
002450	康得新	30.80	362.88	3.20	002142	宁波银行	12.47	208.71	1.84
002594	比亚迪	49.85	245.01	2.16	002018	华信国际	44.08	207.25	1.83

**涨幅前 5 名样本股**

代码	简称	收盘	涨幅%	贡献点数
002151	北斗星通	54.26	19.94	6.01
002266	浙富控股	9.57	13.25	9.00
002024	苏宁云商	14.41	4.50	14.97
002142	宁波银行	12.47	-5.24	-7.27
002001	新和成	15.23	-5.75	-2.69

**跌幅前 5 名样本股**

代码	简称	收盘	涨幅%	贡献点数
002340	格林美	10	-33.82	-32.35
002673	西部证券	16.51	-32.25	-46.09
002073	软控股份	12.11	-32.00	-20.91
002312	三泰控股	17.94	-31.53	-21.15
002063	远光软件	15.39	-30.68	-17.76

**行业分布 (2015.08.31)**

行业	家数	权重 (%)	贡献点数
信息技术	27	28.46	-399.01
工业	16	16.34	-150.07
可选消费	11	12.68	-82.89
医药卫生	15	12.26	-129.00
原材料	12	12.17	-150.12
金融地产	7	7.59	-156.75
主要消费	7	5.57	-98.70
电信业务	4	3.20	-36.25
能源	1	1.74	0.00
公用事业	/	/	/
总计	100	100	-1202.79

**市场分布 (2015.08.31)**

市场	家数	权重 (%)	贡献点数
深市主板	/	/	/
深市中小板	100	100.00	-1202.79
创业板	/	/	/
沪市	/	/	/
总计	100	100	-1202.79

**样本股自由流通市值分布 (2015.08.31)**

最大	最小	均值	中值
552.15	31.22	113.31	83.55

**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
1996.87	-21.38%	-542.98	330.95	9398.72	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
15817.43	7548.21	43.83%	69.69	68.59	0.32%

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	33.19	348.10	4.61	300017	网宿科技	44.72	193.43	2.56
300027	华谊兄弟	39.58	309.45	4.10	300058	蓝色光标	14.30	172.07	2.28
300104	乐视网	33.83	307.16	4.07	300287	飞利信	54.26	150.28	1.99
300024	机器人	57.01	259.36	3.44	300142	沃森生物	48.70	148.90	1.97
300070	碧水源	43.40	229.87	3.05	300168	万达信息	23.49	147.60	1.96

**涨幅前 5 名样本股**

代码	简称	收盘	涨幅%	贡献点数
300216	千山药机	47.74	24.97	5.95
300182	捷成股份	37.07	18.81	2.57
300363	博腾股份	34.53	15.10	1.15
300058	蓝色光标	14.3	9.08	3.79
300026	红日药业	18.49	3.01	0.54

**跌幅前 5 名样本股**

代码	简称	收盘	涨幅%	贡献点数
300047	天源迪科	12.34	-57.54	-9.11
300228	富瑞特装	39.24	-46.71	-7.93
300178	腾邦国际	18.85	-43.97	-10.44
300020	银江股份	14.8	-43.83	-12.09
300033	同花顺	41.37	-41.26	-13.57

**行业分布 (2015.08.31)**

行业	家数	权重 (%)	贡献点数
信息技术	41	40.61	-281.87
工业	19	20.32	-98.14
医药卫生	15	14.30	-59.45
可选消费	11	13.68	-57.19
电信业务	7	6.20	-31.33
原材料	5	3.34	-13.25
主要消费	1	1.03	-1.74
能源	1	0.52	0.00
金融地产	/	/	/
公用事业	/	/	/
总计	100	100	-542.98

**市场分布 (2015.08.31)**

市场	家数	权重 (%)	贡献点数
深市主板	/	/	/
中小板	/	/	/
创业板	100	100.00	-542.98
沪市	/	/	/
总计	100	100.00	-542.98

**样本股自由流通市值分布 (2015.08.31)**

最大	最小	均值	中值
348.10	19.64	75.48	59.43

**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
3697.98	-13.75%	-589.74	1228.92	17987.73	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
43866.62	21785.98	25.22%	24.33	23.89	1.23%

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%
000002	万科A	13.80	1112.44	5.11	002024	苏宁云商	14.41	552.15	2.53
000651	格力电器	18.45	798.74	3.67	000917	电广传媒	42.83	453.74	2.08
000725	京东方A	3.07	682.06	3.13	000858	五粮液	25.73	428.97	1.97
000001	平安银行	11.07	659.03	3.03	002415	海康威视	32.39	402.18	1.85
000333	美的集团	28.79	555.56	2.55	000776	广发证券	13.46	368.50	1.69

**涨幅前 5 名样本股**

代码	简称	收盘	涨幅%	贡献点数
000425	徐工机械	13.05	18.42	4.79
300058	蓝色光标	14.3	9.08	2.43
000800	一汽轿车	17.51	6.51	1.39
002024	苏宁云商	14.41	4.50	4.03
000876	新希望	18.99	4.11	1.18

**跌幅前 5 名样本股**

代码	简称	收盘	涨幅%	贡献点数
000709	河北钢铁	4.44	-36.57	-18.35
300168	万达信息	23.49	-34.22	-13.03
300024	机器人	57.01	-33.57	-22.24
300059	东方财富	33.19	-32.95	-29.03
002673	西部证券	16.51	-32.25	-12.43

**行业分布 (2015.08.31)**

行业	家数	权重 (%)	贡献点数
金融地产	18	23.07	-77.72
可选消费	16	21.94	-143.19
工业	18	17.12	-176.26
信息技术	13	10.95	-74.20
原材料	12	8.55	-43.84
主要消费	9	7.44	-20.54
医药卫生	8	5.75	-21.40
电信业务	3	3.40	-28.35
能源	2	1.29	-1.39
公用事业	1	0.50	-2.85
总计	100	100	-589.74

**市场分布 (2015.08.31)**

市场	家数	权重 (%)	贡献点数
深市主板	59	64.48	-313.46
中小板	30	24.83	-161.37
创业板	11	10.68	-114.90
沪市	/	/	/
总计	100	100	-589.74

**样本股自由流通市值分布 (2015.08.31)**

最大	最小	均值	中值
1112.44	57.64	217.86	169.75

**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
3855.87	-12.84%	-568.02	9890.61	130597.74	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
320976.93	125319.49	73.59%	17.96	17.86	1.77%

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	30.29	2989.61	2.39	601328	交通银行	6.37	1279.78	1.02
600016	民生银行	8.57	2276.89	1.82	000002	万科A	13.80	1112.44	0.89
600036	招商银行	17.05	2040.73	1.63	600030	中信证券	15.07	1095.58	0.87
601166	兴业银行	14.58	1862.95	1.49	601288	农业银行	2.99	1072.26	0.86
600000	浦发银行	14.96	1557.67	1.24	601989	中国重工	12.40	1051.89	0.84

**涨幅前 5 名样本股**

代码	简称	收盘	涨幅%	贡献点数
600868	梅雁吉祥	7.09	73.35	1.71
002070	众和股份	16	64.10	0.80
600628	新世界	20.02	47.70	0.60
600006	东风汽车	13.38	45.28	1.02
600058	五矿发展	37.31	37.17	1.25

**跌幅前 5 名样本股**

代码	简称	收盘	涨幅%	贡献点数
600754	锦江股份	28.41	-100.00	-0.02
600312	平高电气	22.08	-100.00	-0.09
600366	宁波韵升	16.56	-52.81	-1.92
002268	卫士通	41.37	-51.21	-2.95
600395	盘江股份	7.64	-50.36	-1.20

**行业分布 (2015.08.31)**

行业	家数	权重 (%)	贡献点数
金融地产	114	27.55	-150.01
工业	220	19.98	-103.34
可选消费	127	11.52	-54.28
信息技术	136	10.16	-99.60
原材料	149	9.61	-54.41
医药卫生	84	6.44	-36.64
主要消费	58	5.42	-21.22
公用事业	39	3.85	-12.78
能源	41	3.09	-19.12
电信业务	32	2.39	-16.61
总计	1000	100	-568.02

**市场分布 (2015.08.31)**

市场	家数	权重 (%)	贡献点数
深市主板	199	18.65	-100.81
中小板	206	13.17	-90.66
创业板	83	5.25	-58.02
沪市	512	62.93	-318.53
总计	1000	100	-568.02

**样本股自由流通市值分布 (2015.08.31)**

最大	最小	均值	中值
2989.61	14.31	125.32	71.46



## 指数发布动态

指数代码	指数名称	指数简称	基日	发布日	基日点位
CN6112	国证货币基金指数	货基指数	2003-12-31	2015-08-06	1000
399680	深成能源行业指数	深成能源	2010-06-30	2015-08-31	1000
399681	深成原材料行业指数	深成材料	2010-06-30	2015-08-31	1000
399682	深成工业行业指数	深成工业	2010-06-30	2015-08-31	1000
399683	深成可选消费行业指数	深成可选	2010-06-30	2015-08-31	1000
399684	深成主要消费行业指数	深成消费	2010-06-30	2015-08-31	1000
399685	深成医药卫生行业指数	深成医药	2010-06-30	2015-08-31	1000
399686	深成金融地产行业指数	深成金融	2010-06-30	2015-08-31	1000
399687	深成信息技术行业指数	深成信息	2010-06-30	2015-08-31	1000
399688	深成电信业务行业指数	深成电信	2010-06-30	2015-08-31	1000
399689	深成公用事业行业指数	深成公用	2010-06-30	2015-08-31	1000

## 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](mailto:index@cninfo.com.cn)

网址：[www.cnindex.com.cn](http://www.cnindex.com.cn)