

2015年10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10月份，市场呈现普遍上涨行情。核心指数中，创业板指数表现最佳，本月上涨19%。

行业指数方面，深证行业指数中，深A软件与互联网指数单月涨幅为26.54%，在深证行业指数中涨幅最大。国证行业指数中，国证网络软件指数表现最好，单月上涨33.32%。

主题指数方面，深证系列主题指数中，中创高新指数表现较优，涨幅为30.55%。国证主题系列指数中，国证计算机指数表现最佳，涨幅为23.47%。

人民币系列指数中，人民币指数上涨0.79%，而人民币实际指数本月下跌了-0.64%，而近一年涨幅则分别为5.79%和5.48%。

深证系列指数		2015年10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
399652	中创高新指数	30.55%	-12.97%	-6.91%	72.55%
国证系列指数		2015年10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
CN5103	网络软件指数	33.32%	-15.39%	-30.68%	125.45%

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
399001	深证成指	15.60%	-19.47%	-22.08%	40.37%	44.50%
399005	中小板指	14.99%	-15.56%	-11.18%	40.28%	45.39%
399006	创业板指	18.99%	-13.30%	-13.28%	63.77%	53.00%
399007	深证 300	14.81%	-20.32%	-19.25%	41.53%	43.99%
399008	中小板 300	16.55%	-16.69%	-9.74%	41.55%	45.13%
399009	深证 200	16.71%	-18.61%	-16.34%	45.10%	47.20%
399010	深证 700	18.60%	-18.90%	-8.47%	48.34%	45.83%
399011	深证 1000	16.42%	-19.71%	-14.85%	44.41%	44.16%
399012	创业板 300	18.42%	-14.84%	-8.34%	67.04%	50.95%
399015	中小创新	18.74%	-20.37%	-8.63%	46.65%	46.33%
399330	深证 100	13.44%	-21.55%	-21.31%	38.53%	43.00%
399611	中创 100R	15.63%	-14.23%	-12.91%	50.02%	47.57%
399612	中创 100	15.63%	-14.32%	-13.19%	49.38%	47.59%
399624	中创 400	18.56%	-16.82%	-7.56%	49.27%	46.99%
399625	中创 500	17.34%	-15.81%	-9.98%	49.25%	46.73%

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	18.66%	-18.79%	-7.28%	52.30%	47.03%
399310	国证 40	7.48%	-19.92%	-25.49%	37.98%	41.17%
399311	国证 1000	12.65%	-20.89%	-22.19%	42.65%	42.23%
399312	国证 300	10.15%	-21.53%	-26.00%	42.33%	41.37%
399313	巨潮 100	8.40%	-21.21%	-28.08%	37.60%	41.07%
399314	巨潮大盘	10.14%	-21.02%	-26.69%	41.15%	41.38%
399315	巨潮中盘	14.36%	-21.46%	-19.10%	41.69%	47.43%
399316	巨潮小盘	17.24%	-19.98%	-13.32%	46.28%	47.58%
399400	大中盘指	11.40%	-21.15%	-24.49%	41.50%	41.79%
399401	中小盘指	15.73%	-20.76%	-16.37%	43.88%	47.37%

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 市值	总市值 覆盖率	静态	滚动	股息率	ROE
					PE	PE		
399001	深证成指	109665.86	52014.83	55.63%	38.40	34.51	0.76%	9.57%
399005	中小板指	28748.53	12383.89	33.48%	43.98	36.89	0.62%	11.08%
399006	创业板指	19972.15	9445.70	43.92%	89.16	80.25	0.25%	9.40%
399330	深证 100	46685.98	23124.69	23.68%	25.85	22.47	1.17%	11.27%
399007	深证 300	83867.82	40316.47	42.54%	33.76	30.04	0.86%	10.06%
399009	深证 200	37181.84	17191.78	18.86%	54.89	52.11	0.48%	7.83%
399010	深证 700	69020.84	30540.73	35.01%	73.35	71.43	0.41%	6.44%
399011	深证 1000	152888.65	70857.20	77.56%	44.63	40.67	0.66%	8.71%
399008	中小板 300	53329.99	22709.69	62.10%	53.94	47.33	0.54%	9.21%
399012	创业板 300	35086.35	16078.09	77.16%	94.53	87.38	0.26%	7.70%
399015	中小创新	43222.80	18842.37	21.93%	75.92	74.47	0.40%	6.02%
399612	中创 100	32749.40	14885.93	24.93%	46.92	38.94	0.58%	11.35%
399625	中创 500	81485.13	36032.11	62.04%	61.91	54.58	0.47%	8.90%
399624	中创 400	48735.73	21146.18	37.10%	78.81	74.75	0.39%	7.16%
399310	国证 50	127330.90	39241.53	26.83%	10.04	9.87	3.05%	13.26%
399313	巨潮 100	159659.03	52915.13	33.65%	11.33	10.98	2.71%	13.00%
399312	国证 300	231276.77	84812.19	48.74%	14.53	13.80	2.15%	12.06%
399311	国证 1000	340213.63	133762.06	71.70%	19.04	18.16	1.64%	11.08%
399314	巨潮大盘	201514.68	72117.05	42.47%	13.27	12.64	2.33%	12.51%
399315	巨潮中盘	72848.01	31883.53	15.35%	46.09	45.01	0.72%	6.96%
399316	巨潮小盘	65850.94	29761.47	13.88%	59.42	55.53	0.54%	6.44%
399400	大中盘	274362.69	104000.59	57.82%	16.37	15.64	1.90%	11.63%
399401	中小盘	138698.94	61645.00	29.23%	51.57	49.45	0.63%	6.74%
399303	国证 2000	107889.06	45960.08	22.74%	88.27	90.67	0.40%	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	10.74%	-27.97%	-28.50%	15.22%	48.28%
399614	深证材料指数	14.86%	-24.16%	-18.39%	33.09%	42.38%
399615	深证工业指数	16.78%	-18.82%	-11.48%	49.75%	46.30%
399616	深证可选消费	11.49%	-19.47%	-13.54%	43.42%	41.84%
399617	深证主要消费	10.64%	-18.42%	-13.94%	29.58%	42.64%
399618	深证医药卫生	13.27%	-13.81%	-9.00%	33.62%	44.63%
399619	深证金融地产	16.01%	-23.32%	-29.99%	47.42%	45.50%
399620	深证信息技术	20.74%	-19.39%	-17.93%	53.39%	51.40%
399621	深证电信指数	23.59%	-10.50%	-3.36%	51.98%	53.38%
399622	深证公用事业	14.91%	-23.77%	-17.63%	56.00%	53.04%
399674	深 A 医药卫生	15.68%	-14.39%	-5.99%	36.06%	45.67%
399675	深 A 软件与互联网	26.54%	-16.10%	-19.06%	89.59%	59.46%
399680	深成能源指数	4.66%	-29.60%	-28.22%	9.54%	47.82%
399681	深成材料指数	15.09%	-22.66%	-19.85%	29.90%	43.23%
399682	深成工业指数	14.85%	-19.96%	-13.01%	49.88%	46.33%
399683	深成可选指数	11.18%	-19.30%	-14.93%	40.48%	42.42%
399684	深成消费指数	11.57%	-17.22%	-13.72%	27.78%	44.75%
399685	深成医药指数	13.37%	-14.04%	-7.82%	33.76%	44.01%
399686	深成金融指数	16.84%	-23.52%	-28.20%	48.73%	45.75%
399687	深成信息指数	21.25%	-17.88%	-16.59%	59.84%	51.84%
399688	深成电信指数	21.05%	-10.35%	-11.88%	49.91%	52.42%
399689	深成公用指数	15.96%	-23.07%	-17.15%	53.92%	51.43%

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	7.14%	-31.05%	-30.19%	9.99%	46.13%
399382	国证 1000 材料	13.00%	-26.63%	-26.32%	23.55%	47.90%
399383	国证 1000 工业	12.08%	-21.50%	-25.50%	55.31%	48.97%
399384	国证 1000 可选	11.83%	-18.58%	-15.75%	39.65%	44.24%
399385	国证 1000 消费	9.64%	-17.78%	-14.34%	30.15%	41.88%
399386	国证 1000 医药	14.32%	-13.39%	-9.45%	34.72%	43.97%
399387	国证 1000 金融	10.26%	-20.72%	-25.99%	45.67%	41.94%
399388	国证 1000 信息	22.15%	-20.04%	-19.49%	52.70%	52.57%
CN5110	国证 1000 电信	19.61%	-13.83%	-16.28%	52.29%	54.63%
399390	国证 1000 公用	9.91%	-25.00%	-18.98%	49.09%	49.10%

399431	国证银行指数	3.29%	-14.51%	-16.25%	41.70%	41.91%
399432	国证汽车指数	12.18%	-15.11%	-15.07%	28.37%	46.16%
399433	国证交运指数	6.63%	-24.55%	-20.41%	68.93%	50.43%
399434	国证传媒指数	8.41%	-14.79%	-14.69%	33.98%	44.41%
399435	国证农牧指数	10.17%	-18.85%	-12.99%	31.41%	52.23%
399436	国证煤炭指数	9.18%	-32.04%	-27.82%	15.66%	53.07%
399437	国证证券指数	19.13%	-33.39%	-46.30%	38.16%	58.61%
399438	国证电力指数	7.67%	-26.19%	-15.43%	54.33%	47.74%
399439	国证油气指数	9.36%	-27.44%	-32.68%	8.75%	45.01%
399440	国证钢铁指数	6.95%	-35.90%	-31.94%	38.99%	47.12%
CN5073	国证能源指数	7.18%	-30.41%	-29.50%	13.74%	46.46%
CN5074	国证非银指数	15.73%	-27.80%	-38.59%	44.41%	51.29%
CN5075	国证软件指数	27.94%	-19.76%	-24.61%	76.90%	63.13%
CN5076	国证生科指数	7.58%	-11.69%	-0.43%	50.58%	42.37%
CN5077	国证电影指数	5.34%	-9.50%	-5.00%	46.63%	55.79%
CN5078	国证家电指数	12.99%	-30.67%	-24.81%	34.13%	49.16%
CN5079	国证中药指数	16.70%	-17.31%	-14.26%	30.22%	50.37%
CN5080	国证建材指数	4.21%	-27.42%	-28.11%	18.20%	48.36%
CN5081	国证白酒指数	10.22%	-16.39%	-8.07%	42.95%	41.85%
CN5082	国证航天指数	25.39%	-19.48%	-8.19%	44.96%	72.15%
CN5083	国证半导指数	22.27%	-23.86%	-23.36%	20.45%	59.57%
CN5084	电信服务指数	16.21%	-9.69%	-23.71%	74.38%	55.06%
CN5085	服装纺织指数	14.71%	-14.36%	-2.10%	75.88%	50.04%
CN5086	工业服务指数	10.56%	-18.92%	-29.40%	69.11%	49.43%
CN5087	工业用品指数	17.66%	-20.21%	-19.58%	47.54%	53.41%
CN5088	国证公用指数	9.85%	-25.22%	-18.12%	50.46%	48.56%
CN5089	国证材料指数	11.47%	-30.12%	-30.48%	19.49%	48.78%
CN5090	国证化工指数	16.64%	-19.34%	-10.78%	40.92%	48.79%
CN5091	电脑硬件指数	17.03%	-20.67%	-10.54%	39.92%	49.34%
CN5092	国证家用指数	11.92%	-25.71%	-22.76%	7.38%	47.20%
CN5093	国证零售指数	19.11%	-16.57%	-12.15%	54.73%	54.13%
CN5094	耐用消费指数	11.94%	-27.07%	-19.82%	46.12%	45.60%
CN5095	食品零售指数	11.47%	-19.00%	-15.26%	32.27%	52.45%
CN5096	国证通信指数	23.37%	-16.79%	-7.78%	44.01%	56.02%
CN5097	消费服务指数	10.96%	-20.00%	-20.85%	38.04%	48.31%
CN5098	国证医疗指数	19.93%	-17.28%	-9.48%	47.84%	59.67%
CN5099	国证制药指数	15.99%	-13.64%	-11.60%	31.75%	47.80%
CN5100	白色家电指数	8.79%	-34.53%	-29.10%	27.45%	50.35%
CN5101	国证百货指数	14.93%	-15.09%	-12.32%	56.83%	49.79%
CN5102	国证空运指数	13.45%	-35.99%	-22.77%	94.77%	68.52%
CN5103	网络软件指数	33.32%	-15.39%	-30.68%	125.45%	67.69%
CN5104	建筑工程指数	11.37%	-20.33%	-37.60%	82.16%	57.03%
CN5105	路桥港口指数	11.87%	-18.54%	-22.37%	42.74%	55.22%

Index Statistics Report October 2015

CN5106	酒店餐饮指数	11.18%	-18.48%	-8.17%	58.96%	46.39%
CN5107	国证水务指数	22.38%	-16.69%	-27.24%	32.46%	59.21%
CN5108	国证机械指数	18.98%	-19.70%	-17.74%	35.83%	56.18%

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	13.99%	-18.21%	-16.58%	41.06%	42.91%
399348	深证 300 价值	12.64%	-25.15%	-24.19%	32.96%	43.31%
399628	深证 700 成长	18.05%	-18.59%	-9.96%	53.32%	46.99%
399629	深证 700 价值	18.60%	-20.54%	-10.31%	45.27%	48.51%
399630	深证 1000 成长	14.68%	-19.56%	-15.33%	45.16%	43.68%
399631	深证 1000 价值	14.92%	-23.40%	-19.56%	39.58%	43.87%
399602	中小 300 成长	13.56%	-17.86%	-11.03%	44.24%	43.09%
399604	中小 300 价值	17.10%	-19.03%	-13.75%	36.71%	47.44%
399667	创业 300 成长	16.87%	-12.85%	-10.25%	62.58%	53.64%
399668	创业 300 价值	19.34%	-16.98%	-5.68%	56.04%	52.06%
399626	中创 500 成长	15.05%	-15.03%	-11.66%	50.58%	47.19%
399627	中创 500 价值	18.26%	-18.61%	-12.62%	39.19%	47.73%

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	10.61%	-18.46%	-18.50%	41.00%	39.04%
399371	国证 1000 价值	8.76%	-21.18%	-23.71%	45.69%	41.01%
399372	1000 大盘成长	8.40%	-17.75%	-20.84%	39.81%	38.43%
399373	1000 大盘价值	6.07%	-20.06%	-26.07%	44.65%	40.98%
399374	1000 中盘成长	12.00%	-18.11%	-17.48%	33.87%	43.95%
399375	1000 中盘价值	12.36%	-22.34%	-19.73%	52.87%	49.35%
399376	1000 小盘成长	15.44%	-20.66%	-13.37%	47.61%	47.14%
399377	1000 小盘价值	15.90%	-24.08%	-18.59%	38.51%	52.20%

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	30.55%	-12.97%	-6.91%	72.55%	57.30%
399678	深证次新股指数	25.92%	-15.08%	-8.62%	51.33%	51.08%
399339	深证科技指数	19.90%	-16.28%	-14.82%	47.63%	50.71%
399643	创业新兴产业	19.72%	-13.05%	-9.16%	73.35%	52.41%
399608	深证科技 100	19.59%	-14.01%	-10.50%	47.25%	50.82%
399636	深证装备指数	19.43%	-18.58%	-13.90%	41.24%	51.24%
399642	中小新兴产业	19.39%	-15.14%	-9.38%	41.40%	48.40%
399649	中小红利指数	18.76%	-16.56%	-12.73%	41.40%	46.17%
399641	深证新兴产业	18.11%	-17.83%	-15.34%	46.78%	48.29%
399610	深证 TMT50	17.94%	-16.22%	-17.29%	58.87%	49.37%
399638	深证环保指数	16.28%	-11.54%	-13.25%	49.34%	47.42%
399637	深证地产指数	16.13%	-21.27%	-18.09%	63.11%	44.98%
399337	深证民营指数	15.97%	-14.64%	-16.78%	46.09%	46.49%
399651	中小责任指数	15.35%	-13.98%	-5.92%	50.14%	45.13%
399013	深市精选指数	15.28%	-19.96%	-17.01%	39.79%	42.73%
399335	深证央企指数	14.29%	-21.74%	-15.46%	44.01%	41.84%
399669	深证农业指数	14.24%	-18.25%	-12.60%	34.83%	44.93%
399341	深证责任指数	13.89%	-21.67%	-19.89%	37.78%	43.77%
399647	深证医药 50	13.38%	-13.46%	-6.22%	33.83%	43.73%
399670	深证周期 50	13.31%	-25.63%	-28.05%	27.11%	44.59%
399639	深证大宗商品	12.79%	-27.83%	-25.31%	21.25%	45.12%
399332	深证创新指数	12.76%	-23.61%	-22.82%	32.90%	48.06%
399650	中小治理指数	12.35%	-16.95%	-11.49%	39.63%	44.72%
399654	深证文化指数	12.25%	-15.23%	-11.31%	74.43%	40.80%
399653	深证龙头指数	11.56%	-18.89%	-15.28%	45.71%	41.41%
399324	深证红利指数	11.34%	-25.78%	-26.07%	36.41%	44.15%
399646	深证消费 50	10.65%	-18.69%	-13.87%	37.55%	41.64%
399671	深证防御 50	10.40%	-13.47%	-7.91%	42.67%	39.97%
399328	深证治理指数	9.77%	-23.82%	-20.39%	34.49%	40.83%

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
399363	国证计算机指数	23.47%	-17.89%	-16.11%	48.09%	52.00%
399389	国证 1000 电信	21.16%	-15.26%	-10.52%	62.78%	51.14%
399368	国证航天军工	20.46%	-18.86%	-8.64%	55.27%	61.92%

Index Statistics Report October 2015

399428	国证定向增发	20.04%	-20.25%	-13.58%	64.19%	57.28%
399418	国证国家安全	17.61%	-19.55%	-14.96%	43.90%	51.49%
399392	国证新兴产业	17.59%	-16.03%	-15.95%	49.73%	50.15%
399361	国证商业连锁	17.45%	-14.13%	-11.46%	49.28%	52.18%
399420	国证保证指数	17.04%	-29.88%	-41.22%	41.40%	52.88%
399412	国证新能指数	16.61%	-15.65%	-15.01%	38.59%	48.33%
399393	国证地产指数	16.37%	-19.30%	-20.89%	63.66%	46.42%
399419	国证高铁指数	16.36%	-18.45%	-29.77%	65.44%	51.35%
399367	国证地产指数	16.24%	-18.63%	-18.01%	64.43%	46.37%
399394	国证医药指数	15.60%	-12.53%	-8.13%	36.89%	45.12%
399395	国证有色指数	14.00%	-30.20%	-35.28%	8.91%	50.78%
399362	国证民营指数	13.99%	-16.79%	-18.07%	46.13%	42.31%
399360	国证装备指数	13.33%	-21.53%	-26.62%	42.10%	54.17%
399402	国证周期 100	12.20%	-25.96%	-32.90%	31.82%	45.07%
399403	国证防御 100	11.38%	-14.20%	-14.94%	36.05%	41.79%
399319	国证资源优势	11.37%	-30.76%	-33.36%	13.44%	48.63%
399366	国证大宗商品	10.92%	-29.78%	-31.35%	15.74%	48.15%
399365	国证农业指数	10.53%	-17.71%	-14.83%	31.08%	41.61%
399396	国证食品指数	9.82%	-19.37%	-13.18%	31.95%	39.19%
399441	国证生物医药	9.33%	-10.68%	1.89%	54.16%	40.56%
399359	国证基建指数	8.57%	-22.33%	-29.25%	60.09%	49.80%
399353	国证物流指数	8.19%	-23.47%	-18.13%	65.69%	48.44%
399320	国证服务指数	8.10%	-21.65%	-18.54%	58.23%	45.39%
399322	国证治理指数	7.02%	-18.64%	-20.06%	38.04%	37.99%
399321	国证红利指数	5.91%	-20.54%	-26.72%	36.76%	40.91%

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	9.57%	-18.55%	-23.11%	47.72%	39.99%
399355	长三角指数	11.45%	-18.76%	-25.39%	45.65%	44.71%
399356	珠三角指数	9.20%	-22.14%	-25.96%	46.08%	41.47%
399357	环渤海指数	6.86%	-22.34%	-26.48%	36.77%	40.15%
CN6023	陕西指数	20.42%	-23.62%	-20.90%	50.54%	55.28%
CN6007	贵州指数	19.79%	-17.12%	-13.52%	41.87%	41.40%
CN6015	江苏指数	19.65%	-17.20%	-9.42%	50.53%	45.81%
CN6006	广西指数	19.44%	-22.57%	-19.01%	48.53%	46.84%
CN6017	辽宁指数	19.05%	-23.72%	-20.37%	33.84%	49.60%
CN6022	山西指数	10.97%	-30.92%	-30.95%	10.74%	52.64%
CN6002	北京指数	10.85%	-19.33%	-21.95%	53.64%	40.29%

CN6008	海南指数	9.14%	-27.96%	-20.85%	36.94%	40.23%
CN6018	内蒙古指	9.04%	-20.56%	-20.28%	32.70%	42.87%
CN6019	宁夏指数	6.69%	-8.20%	-2.30%	41.66%	36.65%

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	13.65%	-20.05%	-19.06%	49.18%	43.29%
399633	深证 300 等权	15.92%	-19.15%	-16.52%	47.15%	45.65%
399634	中小板等权指数	16.64%	-15.78%	-10.43%	42.42%	46.02%
399635	创业板等权指数	21.60%	-11.68%	-7.28%	62.47%	51.42%
399645	深证 100 低波	10.37%	-21.14%	-17.88%	52.49%	40.26%
399655	深证绩效指数	14.94%	-18.28%	-11.47%	36.33%	47.94%
399656	深证 100 绩效	12.80%	-17.85%	-16.71%	41.76%	43.66%
399657	深证 300 绩效	15.95%	-17.76%	-14.79%	42.96%	46.02%
399658	中小板指绩效	17.08%	-16.35%	-11.90%	38.09%	46.60%
399659	深证成份等权	16.99%	-17.76%	-16.61%	60.05%	45.96%
399660	中创 100 等权	15.73%	-14.71%	-12.48%	48.13%	46.95%
399661	深证 300 低波	10.98%	-18.68%	-16.20%	50.68%	41.12%
399662	深证 300 高贝	19.14%	-20.47%	-17.13%	47.67%	50.94%
399663	中小 300 低波	13.26%	-17.06%	-12.80%	38.64%	43.34%
399664	中小 300 高贝	20.62%	-15.63%	-3.94%	52.04%	49.59%
399665	中创 500 低波	15.08%	-17.89%	-11.18%	40.28%	44.35%
399666	中创 500 高贝	20.50%	-14.62%	-5.99%	56.81%	49.52%
399672	深红利 50 指数	15.32%	-22.45%	-12.99%	46.36%	46.82%
399673	创业板 50 指数	19.88%	-11.67%	-15.23%	70.02%	55.68%
399676	深 A 医药卫生等权	18.51%	-13.38%	-3.17%	40.94%	48.16%
399677	深 A 软件与互联网等权	26.07%	-14.98%	-10.82%	97.69%	59.18%

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	11.14%	-18.33%	-14.52%	32.13%	43.10%
399404	大盘低波	7.67%	-18.11%	-22.84%	61.65%	42.16%
399405	大盘高贝	12.31%	-25.58%	-31.23%	43.35%	44.84%
399406	中盘低波	10.51%	-14.85%	-12.00%	71.39%	43.16%

Index Statistics Report October 2015

399407	中盘高贝	19.14%	-21.38%	-16.99%	35.36%	53.47%
399408	小盘低波	14.49%	-18.39%	-11.41%	51.66%	48.94%
399409	小盘高贝	19.09%	-18.97%	-11.87%	46.98%	50.42%
399411	红利 100	11.43%	-21.02%	-17.78%	44.72%	43.03%
399427	专利领先	18.80%	-15.94%	-8.54%	63.61%	49.73%

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	10.41%	-19.45%	-15.10%	44.67%	43.51%
399358	泰达环保指数	13.43%	-15.91%	-18.76%	33.96%	45.75%
399364	中金龙头消费	10.90%	-16.42%	-15.29%	34.79%	42.16%
399369	CBN-兴业责任	9.44%	-21.82%	-28.10%	34.37%	43.02%
399378	南方低碳指数	11.71%	-20.12%	-20.68%	47.36%	43.06%
399391	国证投资时钟	8.82%	-20.50%	-22.71%	37.57%	41.64%
399644	深证投资时钟	13.93%	-22.71%	-21.72%	30.68%	44.10%
399648	深证 GDP100	4.33%	-24.51%	-15.87%	38.49%	38.10%
399397	华侨城文化	13.64%	-15.10%	-15.99%	58.30%	44.60%
399399	中经 GDP 指数	12.20%	-21.17%	-21.23%	46.72%	41.71%
399350	国元皖江 30	13.71%	-15.82%	-12.02%	53.48%	42.05%
399410	苏州率先指数	22.11%	-26.74%	-18.03%	45.45%	49.15%
CN5061	深证 GDP 对冲	-8.19%	-5.27%	4.65%	-2.72%	10.22%
CN5062	中经 GDP 对冲	1.68%	-0.29%	5.74%	3.30%	6.11%
399415	大数据 100 指数	17.87%	-18.35%	-9.17%	46.60%	50.75%
399416	大数据 300 指数	12.96%	-19.79%	-19.88%	1.10%	43.49%
399429	新丝路指数	15.26%	-24.76%	-23.29%	30.90%	50.69%
399423	中关村 50 指数	16.69%	-19.56%	-15.78%	45.50%	52.63%
CN5069	中关村 A 指	16.60%	-18.21%	-15.08%	56.33%	52.60%

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	9.81%	-19.53%	-19.90%	31.77%	40.74%
399551	央视创新指数	18.15%	-16.04%	-18.15%	45.78%	51.91%
399552	央视成长指数	9.40%	-18.95%	-20.25%	34.72%	39.44%
399553	央视回报指数	11.10%	-16.94%	-19.61%	24.95%	43.47%
399554	央视治理指数	10.22%	-19.49%	-19.77%	34.20%	37.84%
399555	央视责任指数	7.75%	-16.29%	-17.50%	37.55%	38.89%
399556	央视生态指数	11.88%	-17.38%	-14.34%	35.12%	44.06%
399557	央视文化指数	14.93%	-13.82%	-16.82%	61.69%	45.87%

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	0.79%	-0.03%	1.28%	5.79%	5.01%
CNYR	人民币实际指数	-0.64%	-1.13%	0.17%	5.48%	5.50%

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	4.29%	-18.49%	-33.08%	0.13%	53.14%
399307	深证转债指数	10.68%	-9.79%	-4.68%	43.30%	53.37%
399298	深信中高信用	0.33%	2.96%	4.43%	8.23%	1.02%
399299	深信中低信用	0.57%	3.56%	4.95%	8.74%	0.93%
399301	深证信用债	0.43%	3.22%	4.63%	8.53%	0.81%
399302	深证公司债	0.45%	3.12%	4.53%	8.54%	0.81%

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	13.34%	-17.70%	-21.49%	30.11%	34.54%
399305	基金指数	10.43%	-11.65%	-14.04%	25.64%	47.83%
399306	深证 ETF	13.71%	-19.36%	-22.37%	41.78%	48.19%
399379	国证基金	11.60%	-18.02%	-22.15%	33.59%	35.59%
399380	国证 ETF	11.10%	-18.73%	-22.93%	40.36%	43.00%
CN6070	中国股基指数	16.98%	-13.52%	-12.44%	40.94%	46.05%
CN6071	中国混基指数	9.46%	-5.27%	-2.82%	49.14%	29.27%
CN6072	中国债基指数	1.78%	2.70%	4.68%	16.26%	4.82%
CN6112	国证货币基金指数	0.19%	0.93%	1.56%	3.80%	0.10%

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
11546.05	15.6%	1557.8	2756.9	42283.86	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
109665.86	52014.83	55.63%	38.4	34.51	0.76%

权重前 10 名样本公司

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	13.67	1101.96	2.12	300059	东方财富	53.42	560.27	1.08
000651	格力电器	17.35	751.12	1.44	000333	美的集团	28.01	540.51	1.04
000001	平安银行	11.36	676.30	1.30	000917	电广传媒	42.83	453.74	0.87
000725	京东方A	2.98	662.07	1.27	300104	乐视网	47.85	434.46	0.84
002024	苏宁云商	16.26	623.04	1.20	002415	海康威视	34.63	430.00	0.83

涨幅前 5 名样本股

代码	简称	收盘	涨幅%	贡献点数
002432	九安医疗	29.01	120.27	6.16
300033	同花顺	86.65	119.31	18.47
002095	生意宝	73.01	86.25	7.36
300352	北信源	53	80.89	6.62
300355	蒙草抗旱	20.55	72.25	4.23

跌幅前 5 名样本股

代码	简称	收盘	涨幅%	贡献点数
300316	晶盛机电	14.98	-42.16	-7.25
002183	怡亚通	44.79	-38.77	-38.99
002353	杰瑞股份	26.05	-34.74	-13.71
000566	海南海药	36.42	-27.12	-11.52
002369	卓翼科技	14.61	-27.06	-3.66

行业分布 (2015. 10.30)

行业	家数	权重 (%)	贡献点数
信息技术	96	21.00	424.92
工业	100	16.70	249.29
可选消费	63	15.80	183.51
金融地产	39	13.18	219.34
原材料	77	11.27	170.62
医药卫生	49	8.92	121.43
主要消费	29	5.65	67.68
电信业务	23	3.96	79.55
公用事业	13	2.17	34.55
能源	11	1.35	6.92
总计	500	100	1557.81

市场分布 (2015. 10.30)

市场	家数	权重 (%)	贡献点数
深市主板	194	46.50	659.29
深市中小板	212	36.25	597.37
深市创业板	94	17.25	301.15
沪市	/	/	/
总计	500	100	1557.81

样本股自由流通市值分布 (2015. 10.30)

最大	最小	均值	中值
1026.19	14.12	89.99	62.01

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
7795.92	14.99%	1016.22	504.2	9895.67	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
28748.53	12383.89	33.48%	43.98	36.89	0.62%

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	16.26	623.04	5.03	002183	怡亚通	44.79	277.41	2.24
002415	海康威视	34.63	430.00	3.47	002304	洋河股份	62.52	239.11	1.93
002450	康得新	35.75	421.20	3.40	002202	金风科技	15.69	232.71	1.88
002594	比亚迪	67.10	329.80	2.66	002465	海格通信	16.25	230.01	1.86
002230	科大讯飞	37.35	296.56	2.39	002142	宁波银行	13.00	217.58	1.76

涨幅前 5 名样本股

代码	简称	收盘	涨幅%	贡献点数
002439	启明星辰	25.3	20.53	12.73
002594	比亚迪	60.01	20.38	31.44
002570	贝因美	13.32	15.13	5.49
002312	三泰控股	20.35	13.43	6.17
002500	山西证券	11.52	11.95	8.03

跌幅前 5 名样本股

代码	简称	收盘	涨幅%	贡献点数
002183	怡亚通	44.79	-38.77	-110.58
002353	杰瑞股份	26.05	-34.74	-38.90
002252	上海莱士	40.84	-1.59	-2.02
002030	达安基因	45.04	2.60	3.07
002250	联化科技	18.38	2.68	1.57

行业分布 (2015.10.30)

行业	家数	权重 (%)	贡献点数
信息技术	27	29.45	378.57
工业	16	14.47	26.25
可选消费	15	13.31	198.31
医药卫生	12	12.58	140.03
原材料	11	12.31	96.60
金融地产	7	7.89	95.63
主要消费	7	5.83	74.59
电信业务	4	3.22	45.12
能源	1	0.94	-38.90
公用事业	/	/	/
总计	100	100	1016.22

市场分布 (2015.10.30)

市场	家数	权重 (%)	贡献点数
深市主板	/	/	/
深市中小板	100	100.00	1016.22
创业板	/	/	/
沪市	/	/	/
总计	100	100	1016.22

样本股自由流通市值分布 (2015.10.30)

最大	最小	均值	中值
623.04	42.42	123.84	98.18

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
2478.28	19.00%	395.61	345.38	9419.38	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
19972.15	9445.70	43.92%	89.16	80.25	0.25%

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	53.42	560.27	5.93	300070	碧水源	43.69	231.41	2.45
300104	乐视网	47.85	434.46	4.60	300168	万达信息	30.45	191.34	2.03
300024	机器人	77.26	351.48	3.72	300058	蓝色光标	14.30	172.07	1.82
300027	华谊兄弟	36.90	288.49	3.05	300003	乐普医疗	39.81	167.61	1.77
300017	网宿科技	60.26	260.65	2.76	300124	汇川技术	45.80	157.41	1.67

涨幅前 5 名样本股

代码	简称	收盘	涨幅%	贡献点数
300033	同花顺	86.65	119.31	21.83
300352	北信源	53	80.89	7.82
300074	华平股份	15.32	67.25	5.16
300413	快乐购	45.45	66.48	3.33
300431	暴风科技	95.83	64.91	6.53

跌幅前 5 名样本股

代码	简称	收盘	涨幅%	贡献点数
300096	易联众	26	-34.26	-7.18
300251	光线传媒	25.15	-8.51	-2.65
300027	华谊兄弟	36.9	-6.77	-5.50
300216	千山药机	47.6	-0.29	-0.09
300136	信维通信	27.85	0.29	0.07

行业分布 (2015.10.30)

行业	家数	权重 (%)	贡献点数
信息技术	41	44.93	217.54
工业	19	18.46	79.18
医药卫生	15	13.70	45.91
可选消费	11	11.82	10.81
电信业务	7	7.43	28.87
原材料	5	2.28	8.08
主要消费	1	0.96	5.22
能源	1	0.42	0.00
金融地产	/	/	/
公用事业	/	/	/
总计	100	100	395.61

市场分布 (2015.10.30)

市场	家数	权重 (%)	贡献点数
深市主板	/	/	/
中小板	/	/	/
创业板	100	100.00	395.61
沪市	/	/	/
总计	100	100.00	395.61

样本股自由流通市值分布 (2015.10.30)

最大	最小	均值	中值
560.27	26.80	94.46	73.23

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
3925.72	13.44%	465.12	1044.6	14653.35	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
46685.98	23124.69	23.68%	25.85	22.47	1.17%

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	13.67	1101.96	4.77	300059	东方财富	53.42	560.27	2.42
000651	格力电器	17.35	751.12	3.25	000333	美的集团	28.01	540.51	2.34
000001	平安银行	11.36	676.30	2.92	000917	电广传媒	42.83	453.74	1.96
000725	京东方A	2.98	662.07	2.86	300104	乐视网	47.85	434.46	1.88
002024	苏宁云商	16.26	623.04	2.69	002415	海康威视	34.63	430.00	1.86

涨幅前 5 名样本股

代码	简称	收盘	涨幅%	贡献点数
000009	中国宝安	16.00	51.09	11.17
300059	东方财富	53.42	48.47	31.05
002230	科大讯飞	37.35	39.37	14.22
002570	贝因美	18.56	39.34	4.43
000728	国元证券	22.12	37.91	10.22

跌幅前 5 名样本股

代码	简称	收盘	涨幅%	贡献点数
002353	杰瑞股份	26.05	-34.74	-10.49
300027	华谊兄弟	36.90	-6.77	-3.56
002030	达安基因	45.04	2.60	0.83
000629	攀钢钒钛	3.03	3.06	0.54
000061	农产品	14.80	3.28	0.91

行业分布 (2015.10.30)

行业	家数	权重 (%)	贡献点数
金融地产	18	22.50	117.07
可选消费	16	21.94	75.34
工业	18	19.20	115.80
信息技术	13	10.95	60.14
原材料	9	7.45	22.54
主要消费	12	7.18	34.41
医药卫生	8	5.61	21.18
电信业务	3	3.74	21.90
能源	2	0.86	-9.54
公用事业	1	0.59	6.29
总计	100	100	465.12

市场分布 (2015.10.30)

市场	家数	权重 (%)	贡献点数
深市主板	59	61.32	245.53
中小板	30	26.05	146.03
创业板	11	12.63	73.56
沪市	/	/	/
总计	100	100	465.12

样本股自由流通市值分布 (2015.10.30)

最大	最小	均值	中值
1101.96	76.42	231.25	176.13

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
4115.57	12.65%	462.03	6682.31	87732.28	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
340213.63	133762.06	71.70%	19.04	18.16	1.64%

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	33.49	3305.44	2.47	601328	交通银行	6.35	1275.76	0.95
600016	民生银行	8.60	2284.86	1.71	600030	中信证券	15.87	1153.74	0.86
600036	招商银行	17.93	2146.06	1.60	600837	海通证券	14.84	1140.32	0.85
601166	兴业银行	15.27	1951.12	1.46	601288	农业银行	3.14	1126.05	0.84
600000	浦发银行	16.39	1706.57	1.28	000002	万 科 A	13.67	1101.96	0.82

涨幅前 5 名样本股

代码	简称	收盘	涨幅%	贡献点数
600446	金证股份	45.00	299.76	1.50
002432	九安医疗	29.01	120.27	0.85
300033	同 花 顺	86.65	119.31	2.56
002095	生 意 宝	73.01	86.25	1.02
300352	北 信 源	53.00	80.89	0.92

跌幅前 5 名样本股

代码	简称	收盘	涨幅%	贡献点数
601877	正泰电器	30.02	-100.00	-0.07
600634	中技控股	22.1	-40.88	-1.87
002183	怡 亚 通	44.79	-38.77	-5.40
002353	杰瑞股份	26.05	-34.74	-1.90
600277	亿利能源	9.95	-31.57	-1.21

行业分布 (2015. 10.30)

行业	家数	权重 (%)	贡献点数
金融地产	114	27.61	105.70
工业	221	19.63	87.40
可选消费	136	11.37	84.87
信息技术	126	11.32	48.96
原材料	150	9.30	44.21
医药卫生	83	6.57	33.69
主要消费	58	5.24	18.96
公用事业	39	3.54	13.12
能源	41	2.86	7.84
电信业务	32	2.56	17.28
总计	1000	100	462.03

市场分布 (2015. 10.30)

市场	家数	权重 (%)	贡献点数
深市主板	199	18.09	91.84
中小板	206	13.72	80.79
创业板	83	6.12	39.90
沪市	512	62.08	249.51
总计	1000	100	462.03

样本股自由流通市值分布 (2015. 10.30)

最大	最小	均值	中值
3305.44	15.91	133.76	79.19

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