

## 2015年12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12月份，市场呈现普遍上涨行情。核心指数中，深证100指数表现最佳，本月上涨8.83%。

行业指数方面，深证行业指数中，深证金融地产指数单月涨幅为13.76%，在深证行业指数中涨幅最大。国证行业指数中，国证家用指数表现最好，单月上涨13.85%。

主题指数方面，深证系列主题指数中，深证红利指数表现较优，涨幅为17.19%。国证主题系列指数中，国证地产指数表现最佳，涨幅为14.95%。

人民币系列指数中，人民币指数以及人民币实际指数均下跌2.05%，近一年涨幅则分别为1.29%和0.99%。

深证系列指数		2015年12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
399324	深证红利指数	17.19%	33.42%	-11.06%	14.44%

  

国证系列指数		2015年12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
399393	国证地产指数	14.95%	41.48%	-1.89%	36.71%

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	5.21%	26.81%	-11.38%	15.92%	42.07%
399005	中小板指	2.83%	23.81%	-9.08%	53.70%	42.92%
399006	创业板指	1.55%	30.32%	-5.06%	84.41%	50.36%
399007	深证 300	5.72%	25.43%	-12.63%	33.66%	41.64%
399008	中小板 300	4.09%	29.07%	-7.74%	62.39%	42.75%
399009	深证 200	1.66%	24.84%	-12.94%	50.77%	44.60%
399010	深证 700	5.56%	36.81%	-6.44%	76.71%	43.53%
399011	深证 1000	5.65%	30.24%	-10.18%	49.45%	41.85%
399012	创业板 300	3.67%	34.96%	-2.94%	100.17%	48.55%
399015	中小创新	6.79%	40.00%	-6.11%	82.03%	44.08%
399330	深证 100	8.83%	25.86%	-12.46%	23.12%	40.85%
399612	中创 100	2.74%	23.94%	-8.17%	59.05%	45.03%
399624	中创 400	4.41%	35.12%	-5.21%	81.10%	44.69%
399625	中创 500	3.74%	30.45%	-6.40%	71.63%	44.34%

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	7.22%	41.69%	-3.03%	88.14%	44.43%
399310	国证 50	6.60%	15.61%	-13.86%	-3.97%	39.05%
399311	国证 1000	4.22%	20.08%	-15.67%	18.41%	39.81%
399312	国证 300	5.03%	16.59%	-16.94%	6.61%	39.11%
399313	巨潮 100	5.63%	15.65%	-15.94%	-1.57%	38.93%
399314	巨潮大盘	5.22%	17.10%	-16.02%	4.21%	39.18%
399315	巨潮中盘	2.33%	18.69%	-18.49%	28.58%	44.51%
399316	巨潮小盘	3.88%	29.30%	-11.74%	53.37%	44.75%
399400	大中盘指	4.33%	17.58%	-16.78%	10.59%	39.46%
399401	中小盘指	3.09%	23.75%	-15.27%	39.96%	44.49%

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	123913.60	57242.87	52.70%	43.68	39.54	0.67%	9.45%
399005	中小板指	31457.96	13333.67	30.26%	48.12	39.25	0.56%	11.06%
399006	创业板指	23944.72	10456.11	42.82%	105.06	94.38	0.21%	8.91%
399330	深证 100	54348.26	25752.66	23.12%	30.50	26.56	1.00%	11.05%
399007	深证 300	94631.22	44201.26	40.25%	38.45	34.62	0.76%	9.90%
399009	深证 200	40282.96	18448.60	17.13%	59.35	58.61	0.44%	7.78%
399010	深证 700	81768.84	35273.11	34.78%	85.16	83.60	0.35%	6.54%
399011	深证 1000	176400.06	79474.37	75.03%	51.57	47.53	0.57%	8.65%
399008	中小板 300	59944.03	25148.85	57.67%	60.16	51.17	0.48%	9.21%
399012	创业板 300	42455.05	18323.42	75.93%	111.84	101.99	0.21%	7.62%
399015	中小创新	52486.45	22231.50	22.32%	89.91	90.92	0.33%	6.14%
399612	中创 100	37522.24	15955.02	23.47%	53.83	43.87	0.50%	11.05%
399625	中创 500	93733.39	40074.44	58.63%	70.48	60.50	0.40%	8.84%
399624	中创 400	56211.15	24143.63	35.16%	88.82	80.98	0.34%	7.24%
399310	国证 50	131692.15	42200.98	24.89%	10.37	10.48	2.97%	13.11%
399313	巨潮 100	166083.60	56507.26	31.39%	11.79	11.76	2.61%	12.84%
399312	国证 300	240854.05	89826.56	45.52%	15.12	14.83	2.07%	11.94%
399311	国证 1000	359812.69	142663.73	68.01%	20.11	19.83	1.56%	11.00%
399314	巨潮大盘	210113.78	76733.35	39.71%	13.83	13.59	2.24%	12.37%
399315	巨潮中盘	76086.79	33089.99	14.38%	47.94	50.11	0.71%	6.98%
399316	巨潮小盘	73612.11	32840.39	13.91%	65.22	62.81	0.48%	6.54%
399400	大中盘	286200.58	109823.34	54.10%	17.07	16.87	1.83%	11.53%
399401	中小盘	149698.90	65930.38	28.30%	55.11	55.63	0.60%	6.79%
399303	国证 2000	135639.05	54861.30	25.64%	104.74	113.42	0.32%	5.35%

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	0.99%	14.72%	-25.38%	12.84%	45.92%
399614	深证材料指数	4.59%	28.40%	-15.22%	39.82%	40.12%
399615	深证工业指数	3.96%	25.50%	-12.76%	49.23%	43.93%
399616	深证可选消费	7.81%	22.83%	-11.28%	50.16%	39.54%
399617	深证主要消费	9.52%	21.75%	-10.23%	32.77%	39.90%
399618	深证医药卫生	3.36%	18.17%	-10.08%	45.32%	42.30%
399619	深证金融地产	13.76%	46.74%	-3.00%	9.14%	44.47%
399620	深证信息技术	2.22%	32.45%	-11.57%	69.40%	48.83%
399621	深证电信指数	4.66%	39.07%	0.71%	78.81%	50.60%
399622	深证公用事业	-3.24%	15.51%	-23.37%	18.71%	49.62%
399674	深 A 医药卫生	4.35%	24.50%	-7.86%	57.50%	43.17%
399675	深 A 软件与互联网	3.50%	42.91%	-5.25%	111.67%	56.41%
399680	深成能源指数	0.01%	5.60%	-28.96%	3.79%	45.70%
399681	深成材料指数	4.56%	27.91%	-14.05%	30.38%	40.79%
399682	深成工业指数	3.65%	21.29%	-15.48%	41.76%	43.85%
399683	深成可选指数	7.82%	20.37%	-12.63%	43.33%	40.08%
399684	深成消费指数	9.52%	20.56%	-10.56%	28.47%	41.89%
399685	深成医药指数	3.38%	18.76%	-9.95%	46.89%	41.68%
399686	深成金融指数	11.39%	43.46%	-6.10%	13.06%	44.29%
399687	深成信息指数	2.14%	32.43%	-10.31%	73.67%	49.15%
399688	深成电信指数	3.24%	32.89%	-1.59%	65.47%	49.73%
399689	深成公用指数	-4.08%	14.41%	-24.10%	11.98%	48.29%

**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	-0.64%	3.00%	-33.71%	-9.90%	43.33%
399382	国证 1000 材料	3.18%	22.51%	-20.45%	15.15%	44.91%
399383	国证 1000 工业	0.37%	10.58%	-22.54%	20.33%	45.73%
399384	国证 1000 可选	6.39%	19.73%	-12.83%	39.45%	41.46%
399385	国证 1000 消费	7.77%	16.29%	-12.80%	22.83%	39.32%
399386	国证 1000 医药	6.51%	21.96%	-7.61%	48.04%	41.36%
399387	国证 1000 金融	6.94%	23.84%	-10.95%	-1.92%	40.07%
399388	国证 1000 信息	3.21%	34.72%	-11.82%	67.40%	49.81%
CN5110	国证 1000 电信	3.27%	27.94%	-7.83%	55.09%	48.74%
399390	国证 1000 公用	-2.48%	6.41%	-27.39%	5.34%	45.57%
399431	国证银行指数	4.28%	10.65%	-8.42%	-0.83%	39.50%

399432	国证汽车指数	5.84%	21.20%	-8.29%	34.97%	43.29%
399433	国证交运指数	-0.30%	2.12%	-27.74%	23.45%	46.68%
399434	国证传媒指数	1.91%	13.18%	-11.04%	41.95%	42.02%
399435	国证农牧指数	5.23%	22.49%	-9.78%	43.82%	48.58%
399436	国证煤炭指数	-0.48%	6.07%	-33.98%	-7.86%	49.60%
399437	国证证券指数	5.16%	39.58%	-21.96%	-28.53%	58.34%
399438	国证电力指数	-2.34%	4.68%	-28.24%	9.87%	44.33%
399439	国证油气指数	1.12%	7.60%	-28.61%	-8.64%	42.13%
399440	国证钢铁指数	3.38%	7.20%	-35.75%	4.16%	44.39%
CN5073	国证能源指数	0.28%	4.60%	-32.08%	-5.95%	43.21%
CN5074	国证非银指数	5.88%	31.17%	-18.17%	-19.97%	50.08%
CN5075	国证软件指数	4.61%	42.01%	-10.94%	86.77%	59.07%
CN5076	国证生科指数	6.00%	16.08%	-4.71%	77.44%	40.17%
CN5077	国证电影指数	4.05%	26.01%	8.27%	76.56%	53.23%
CN5078	国证家电指数	12.07%	31.79%	-19.13%	37.58%	45.46%
CN5079	国证中药指数	8.38%	29.34%	-8.35%	41.04%	46.42%
CN5080	国证建材指数	5.39%	11.95%	-22.02%	1.80%	45.45%
CN5081	国证白酒指数	7.69%	17.07%	-11.19%	22.19%	39.02%
CN5082	国证航天指数	-1.83%	15.97%	-25.53%	33.49%	66.50%
CN5083	国证半导指数	1.75%	58.07%	-1.57%	65.45%	56.73%
CN5084	电信服务指数	3.87%	19.98%	-6.76%	48.31%	51.78%
CN5085	服装纺织指数	7.10%	25.82%	-6.06%	77.94%	46.37%
CN5086	工业服务指数	0.30%	10.03%	-19.31%	15.33%	45.72%
CN5087	工业用品指数	1.80%	20.51%	-18.27%	36.63%	49.72%
CN5088	国证公用指数	-1.97%	7.36%	-26.91%	8.28%	44.81%
CN5089	国证材料指数	4.33%	20.58%	-24.41%	8.88%	45.61%
CN5090	国证化工指数	3.74%	32.87%	-8.12%	57.66%	45.39%
CN5091	电脑硬件指数	2.35%	28.92%	-12.61%	61.30%	46.50%
CN5092	国证家用指数	13.85%	46.04%	-3.05%	46.81%	43.43%
CN5093	国证零售指数	3.83%	24.82%	-12.57%	50.67%	50.06%
CN5094	耐用消费指数	11.45%	30.42%	-15.03%	51.35%	42.33%
CN5095	食品零售指数	9.75%	19.83%	-12.92%	35.25%	48.52%
CN5096	国证通信指数	4.83%	38.69%	-6.46%	66.24%	52.54%
CN5097	消费服务指数	11.92%	27.42%	-8.14%	42.67%	45.10%
CN5098	国证医疗指数	-1.94%	20.75%	-16.71%	69.50%	55.92%
CN5099	国证制药指数	7.47%	25.21%	-6.77%	44.47%	44.32%
CN5100	白色家电指数	13.27%	30.75%	-21.31%	24.17%	47.07%
CN5101	国证百货指数	8.99%	26.91%	-6.24%	57.96%	46.08%
CN5102	国证空运指数	6.11%	10.87%	-37.44%	32.93%	63.31%
CN5103	网络软件指数	1.22%	44.84%	-8.08%	116.36%	63.45%
CN5104	建筑工程指数	-1.20%	6.93%	-23.51%	1.92%	52.81%
CN5105	路桥港口指数	3.21%	13.12%	-17.63%	18.93%	50.43%
CN5106	酒店餐饮指数	11.52%	26.25%	-7.42%	58.71%	43.40%

**Index Statistics Report December 2015**

CN5107	国证水务指数	2.50%	26.83%	-13.66%	4.15%	54.68%
CN5108	国证机械指数	6.16%	29.11%	-12.86%	37.00%	52.16%

## 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	8.56%	29.63%	-6.99%	40.54%	40.71%
399348	深证 300 价值	10.58%	27.50%	-15.28%	15.63%	41.10%
399628	深证 700 成长	4.31%	35.44%	-6.59%	79.86%	44.68%
399629	深证 700 价值	6.16%	35.79%	-9.02%	64.83%	45.66%
399630	深证 1000 成长	6.68%	29.36%	-9.26%	50.72%	41.46%
399631	深证 1000 价值	8.40%	29.47%	-13.71%	29.92%	41.47%
399602	中小 300 成长	4.29%	22.82%	-11.16%	61.01%	40.96%
399604	中小 300 价值	5.64%	28.37%	-11.24%	46.23%	44.70%
399667	创业 300 成长	1.55%	30.32%	-5.04%	84.79%	50.36%
399668	创业 300 价值	2.90%	29.43%	-6.93%	67.45%	48.04%
399626	中创 500 成长	3.60%	25.99%	-6.95%	66.38%	44.81%
399627	中创 500 价值	5.45%	32.06%	-9.11%	55.00%	45.07%

**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	6.27%	21.95%	-10.10%	26.86%	36.97%
399371	国证 1000 价值	5.33%	16.10%	-15.86%	8.42%	38.55%
399372	1000 大盘成长	8.30%	21.25%	-8.00%	15.11%	36.56%
399373	1000 大盘价值	6.49%	14.09%	-14.01%	0.55%	38.67%
399374	1000 中盘成长	3.18%	18.16%	-13.60%	35.46%	41.50%
399375	1000 中盘价值	2.47%	15.15%	-20.41%	22.45%	46.01%
399376	1000 小盘成长	4.19%	28.21%	-11.88%	59.64%	44.43%
399377	1000 小盘价值	4.20%	25.99%	-17.47%	30.59%	48.61%

## 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
399324	深证红利指数	17.19%	0.3342	-0.1106	0.1444	0.4238
399328	深证治理指数	15.43%	0.2998	-0.098	0.2455	0.3895
399653	深证龙头指数	12.77%	0.2622	-0.0823	0.3475	0.392
399341	深证责任指数	11.08%	0.2924	-0.1111	0.2755	0.4136
399670	深证周期 50	11.02%	0.3447	-0.1174	0.1015	0.4282
399335	深证央企指数	10.33%	0.2968	-0.1119	0.3129	0.3963
399646	深证消费 50	9.75%	0.1807	-0.1323	0.3404	0.3935
399637	深证地产指数	8.72%	0.3526	-0.083	0.4425	0.4299
399669	深证农业指数	7.22%	0.2301	-0.1198	0.3425	0.421
399332	深证创新指数	6.90%	0.1986	-0.188	0.2173	0.4513
399013	深市精选指数	6.21%	0.2761	-0.114	0.3249	0.4047
399651	中小责任指数	6.08%	0.252	-0.0663	0.5557	0.4245
399639	深证大宗商品	5.31%	0.2277	-0.2144	0.1349	0.425
399649	中小红利指数	4.43%	0.2759	-0.1036	0.5376	0.4362
399636	深证装备指数	4.31%	0.2844	-0.1243	0.416	0.4855
399337	深证民营指数	4.14%	0.2395	-0.0877	0.426	0.4409
399641	深证新兴产业	3.99%	0.2887	-0.1034	0.5286	0.4563
399654	深证文化指数	3.97%	0.2242	-0.0755	0.7885	0.3892
399642	中小新兴产业	3.97%	0.3191	-0.0625	0.6541	0.4598
399647	深证医药 50	3.96%	0.1947	-0.0881	0.4694	0.4135
399671	深证防御 50	3.76%	0.1476	-0.1005	0.367	0.3771
399608	深证科技 100	2.90%	0.2943	-0.0693	0.6745	0.4804
399610	深证 TMT50	2.86%	0.2434	-0.1167	0.5901	0.4685
399339	深证科技指数	2.47%	0.2715	-0.1122	0.5493	0.478
399652	中创高新指数	2.41%	0.4604	-0.0264	1.0891	0.5457
399650	中小治理指数	1.90%	0.1917	-0.1192	0.4882	0.4214
399643	创业新兴产业	1.28%	0.3207	-0.0408	0.9485	0.4986
399638	深证环保指数	1.01%	0.24	-0.0566	0.4654	0.4476
399678	深证次新股指数	-6.56%	0.5417	0.0397	1.1024	0.5058

**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
399393	国证地产指数	14.95%	0.4148	-0.0189	0.3671	0.444
399367	巨潮地产指数	14.40%	0.3956	-0.0231	0.3675	0.4436
399396	国证食品指数	8.34%	0.1827	-0.1316	0.232	0.3701
399322	国证治理指数	7.23%	0.1624	-0.1163	0.0647	0.3585



## Index Statistics Report December 2015

399321	国证红利指数	7.18%	0.1537	-0.1345	-0.0391	0.3877
399365	国证农业指数	6.96%	0.1629	-0.1343	0.2058	0.3916
399402	国证周期 100	6.88%	0.243	-0.1798	-0.0678	0.4306
399420	国证保证指数	5.81%	0.3563	-0.1874	-0.2197	0.5239
399389	国证 1000 电信	5.72%	0.3756	-0.0379	0.7595	0.4852
399361	国证商业连锁	5.72%	0.2022	-0.1211	0.4099	0.4859
399394	国证医药指数	5.55%	0.2267	-0.0719	0.5343	0.4233
399441	国证生物医药	5.06%	0.1555	-0.0559	0.7709	0.3869
399412	国证新能指数	4.87%	0.3401	-0.0306	0.597	0.4596
399403	国证防御 100	4.81%	0.1603	-0.1063	0.2903	0.3921
399395	国证有色指数	4.76%	0.2518	-0.2336	0.0157	0.4806
399362	国证民营指数	3.77%	0.2127	-0.1147	0.3321	0.3995
399419	国证高铁指数	3.49%	0.2223	-0.1434	0.3501	0.4809
399363	国证计算机指数	3.19%	0.3424	-0.1073	0.5015	0.4942
399428	国证定向增发	2.84%	0.3776	-0.0847	0.7363	0.5261
399319	国证资源优势	2.76%	0.1524	-0.2836	-0.0301	0.4576
399366	国证大宗商品	2.53%	0.1441	-0.2757	-0.0174	0.4511
399418	国证国家安全	2.49%	0.2228	-0.1636	0.4475	0.4834
399392	国证新兴产业	2.47%	0.2171	-0.1308	0.4855	0.4721
399353	国证物流指数	0.91%	0.0349	-0.2679	0.2234	0.45
399360	国证装备指数	0.41%	0.1024	-0.2367	0.1977	0.5066
399359	国证基建指数	-1.35%	0.0306	-0.2627	0.0187	0.4634
399320	国证服务指数	-1.43%	0.0409	-0.2456	0.1953	0.422
399368	国证航天军工	-1.92%	0.1689	-0.2127	0.3925	0.5773

## 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	10.12%	24.16%	-7.70%	7.68%	38.09%
399355	长三角指数	1.42%	15.94%	-15.48%	4.77%	42.21%
399356	珠三角指数	11.33%	25.30%	-10.66%	7.32%	39.64%
399357	环渤海指数	4.46%	10.87%	-19.42%	-4.18%	37.85%
CN6020	青海指数	12.13%	38.14%	-18.56%	17.56%	49.09%
CN6017	辽宁指数	8.18%	37.54%	-11.88%	37.56%	46.47%
CN6031	重庆指数	8.10%	31.14%	-8.20%	37.61%	43.30%
CN6005	广东指数	7.71%	31.19%	-6.52%	37.36%	38.09%
CN6003	福建指数	7.17%	28.64%	-6.64%	30.97%	39.39%
CN6022	山西指数	2.15%	16.18%	-27.68%	-5.56%	49.21%
CN6001	安徽指数	1.52%	22.50%	-13.85%	38.16%	42.47%
CN6023	陕西指数	1.44%	29.30%	-17.98%	44.33%	52.12%
CN6008	海南指数	1.11%	18.78%	-21.59%	36.33%	37.83%



CN6011	黑龙江指	0.97%	18.21%	-17.83%	33.17%	51.83%
--------	------	-------	--------	---------	--------	--------

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	6.39%	23.73%	-12.96%	30.72%	41.12%
399633	深证 300 等权	3.68%	25.96%	-12.14%	44.76%	43.13%
399634	中小板等权指数	2.46%	26.58%	-8.60%	58.00%	43.41%
399635	创业板等权指数	1.97%	36.90%	-0.57%	97.64%	49.14%
399645	深证 100 低波	9.64%	23.39%	-11.84%	22.57%	38.14%
399655	深证绩效指数	5.69%	27.46%	-9.38%	47.73%	45.03%
399656	深证 100 绩效	9.32%	25.21%	-8.81%	36.54%	41.24%
399657	深证 300 绩效	4.90%	26.49%	-10.28%	46.52%	43.35%
399658	中小板指绩效	2.67%	26.12%	-9.89%	52.79%	43.92%
399659	深证成份等权	3.79%	28.46%	-9.69%	31.90%	43.42%
399660	中创 100 等权	2.69%	25.15%	-7.77%	60.03%	44.37%
399661	深证 300 低波	5.28%	21.33%	-11.09%	28.21%	38.50%
399662	深证 300 高贝	1.92%	28.78%	-14.03%	56.09%	48.04%
399663	中小 300 低波	4.82%	25.56%	-8.05%	49.72%	40.73%
399664	中小 300 高贝	5.64%	39.37%	-2.51%	91.94%	46.99%
399665	中创 500 低波	5.79%	31.62%	-6.08%	63.17%	41.83%
399666	中创 500 高贝	5.07%	38.77%	-1.68%	97.14%	47.21%
399672	深红利 50 指数	7.87%	25.35%	-15.71%	36.03%	44.29%
399673	创业板 50 指数	2.04%	29.67%	-4.46%	84.43%	52.67%
399676	深 A 医药卫生等权	5.59%	32.54%	-3.12%	77.38%	45.47%
399677	深 A 软件与互联网等权	5.17%	50.40%	1.43%	142.30%	56.34%

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	4.51%	19.74%	-12.01%	31.73%	40.32%
399404	大盘低波	6.87%	15.00%	-12.54%	13.52%	39.35%
399405	大盘高贝	4.88%	25.57%	-16.79%	1.31%	43.56%
399406	中盘低波	6.60%	20.57%	-7.09%	41.51%	40.42%
399407	中盘高贝	0.65%	21.99%	-19.50%	35.81%	50.06%
399408	小盘低波	6.90%	27.48%	-9.14%	46.64%	45.61%
399409	小盘高贝	3.36%	32.51%	-9.84%	66.77%	47.47%

**Index Statistics Report December 2015**

399411	红利 100	4.39%	17.74%	-16.55%	18.18%	40.38%
399427	专利领先	5.36%	37.67%	-2.59%	84.37%	47.35%

## 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	6.77%	24.73%	-9.00%	53.94%	41.00%
399358	泰达环保指数	1.58%	17.67%	-12.77%	24.22%	42.78%
399364	中金龙头消费	7.01%	16.33%	-12.34%	29.70%	39.62%
399369	CBN-兴业责任	5.07%	15.33%	-17.61%	7.74%	40.43%
399378	南方低碳指数	7.30%	22.04%	-12.73%	23.29%	40.46%
399391	国证投资时钟	9.32%	17.85%	-13.91%	17.39%	39.20%
399644	深证投资时钟	12.96%	30.74%	-11.30%	20.99%	41.80%
399648	深证 GDP100	7.58%	15.21%	-16.63%	32.43%	36.26%
399397	华侨城文化	5.15%	20.57%	-9.92%	55.78%	42.20%
399399	中经 GDP 指数	5.51%	19.67%	-15.93%	16.29%	39.47%
399350	国元皖江 30	1.28%	17.19%	-13.25%	33.68%	39.81%
399410	苏州率先指数	6.87%	43.68%	-13.80%	55.70%	46.92%
CN5061	深证 GDP 对冲	-1.27%	-8.94%	-6.04%	5.75%	10.10%
CN5062	中经 GDP 对冲	0.77%	2.59%	0.59%	9.49%	5.70%
399415	大数据 100 指数	5.62%	30.60%	-9.54%	69.92%	47.89%
399416	大数据 300 指数	6.90%	26.39%	-10.26%	19.08%	40.89%
399429	新丝路指数	3.78%	26.92%	-17.15%	28.96%	47.55%
399423	中关村 50 指数	3.70%	22.89%	-15.28%	48.07%	49.22%
CN5069	中关村 A 指	2.22%	26.57%	-11.22%	59.24%	49.02%

**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	8.30%	20.93%	-11.39%	15.60%	38.31%
399551	央视创新指数	2.89%	25.64%	-10.71%	52.49%	48.76%
399552	央视成长指数	9.25%	19.11%	-11.75%	18.68%	37.14%
399553	央视回报指数	8.68%	23.84%	-7.41%	32.23%	40.82%
399554	央视治理指数	10.02%	25.36%	-8.44%	17.37%	35.88%
399555	央视责任指数	3.97%	14.19%	-11.28%	5.56%	36.62%
399556	央视生态指数	2.24%	18.33%	-12.61%	36.99%	41.34%
399557	央视文化指数	3.49%	21.67%	-8.77%	62.99%	43.52%

## 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	-2.05%	-1.17%	-1.98%	1.29%	4.84%
CNYR	人民币实际指数	-2.05%	-2.57%	-3.05%	0.99%	5.28%

## 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	0.79%	5.24%	-17.74%	-25.65%	49.05%
399307	深证转债指数	-5.39%	8.78%	-11.33%	17.10%	49.94%
399298	深信中高信用	0.78%	1.12%	3.76%	8.45%	1.00%
399299	深信中低信用	0.73%	1.14%	4.14%	9.08%	0.90%
399301	深证信用债	0.82%	1.18%	4.00%	8.77%	0.81%
399302	深证公司债	0.86%	1.24%	3.93%	8.75%	0.79%

## 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	2.17%	19.44%	-13.27%	8.55%	32.63%
399305	基金指数	5.48%	26.55%	1.25%	33.18%	44.18%
399306	深证 ETF	4.95%	22.55%	-13.10%	14.05%	45.00%
399379	国证基金	2.89%	17.84%	-13.43%	7.51%	33.56%
399380	国证 ETF	4.03%	17.58%	-13.99%	8.38%	40.33%
CN6070	中国股基指数	5.37%	31.35%	-2.90%	43.71%	43.13%
CN6071	中国混基指数	3.64%	19.97%	3.82%	49.74%	28.00%
CN6072	中国债基指数	1.43%	3.35%	4.28%	12.58%	4.37%
CN6112	国证货币基金指数	0.25%	0.72%	1.46%	3.60%	0.09%
CN6113	中国年金指数	2.27%	8.19%	0.99%	15.67%	9.91%
CN6114	生命周期(20-35)基指	4.02%	20.87%	-8.37%	30.00%	31.96%
CN6115	生命周期(15-20)基指	3.23%	15.91%	-5.20%	24.62%	23.88%
CN6116	生命周期(10-15)基指	2.58%	11.28%	-1.89%	19.26%	15.87%
CN6117	生命周期(5-10)基指	1.92%	6.75%	1.25%	13.44%	7.93%
CN6118	生命周期(0-5)基指	1.26%	2.33%	4.20%	7.23%	1.05%

### 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
12664.89	5.21%	627.05	2887.2	50780.92	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
123913.60	57242.87	52.70%	43.68	39.54	0.67%

#### 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	24.43	1969.35	3.44	300059	东方财富	52.03	545.69	0.95
000651	格力电器	22.35	967.58	1.69	300104	乐视网	58.80	533.88	0.93
000001	平安银行	11.99	713.80	1.25	000776	广发证券	19.45	532.49	0.93
000725	京东方 A	2.97	659.85	1.15	002024	苏宁云商	13.45	515.36	0.90
000333	美的集团	32.82	633.32	1.11	000858	五粮液	27.28	454.81	0.79

#### 涨幅前 5 名样本股

代码	简称	收盘	涨幅%	贡献点数
300020	银江股份	24.52	74.89	9.20
000002	万科 A	24.43	62.11	167.13
002292	奥飞动漫	51.71	49.88	14.32
300288	朗玛信息	61.72	48.44	5.02
002019	亿帆鑫富	40	46.04	5.40

#### 跌幅前 5 名样本股

代码	简称	收盘	涨幅%	贡献点数
000519	江南红箭	16.98	-34.84	-1.51
002368	太极股份	67.1	-31.88	0.72
002310	东方园林	26.46	-30.91	-10.92
002092	中泰化学	8.8	-24.91	-6.13
002191	劲嘉股份	15.36	-20.08	-6.83

#### 行业分布 (2015.12.31)

行业	家数	权重 (%)	贡献点数
信息技术	96	20.87	55.57
工业	100	16.02	71.51
可选消费	63	15.55	143.03
金融地产	38	14.76	180.62
原材料	77	11.38	63.00
医药卫生	49	8.49	35.23
主要消费	30	5.80	63.85
电信业务	23	3.95	15.76
公用事业	13	1.95	-10.52
能源	11	1.23	0.01
总计	500	100	627.05

#### 市场分布 (2015.12.31)

市场	家数	权重 (%)	贡献点数
深市主板	193	46.62	434.76
深市中小板	212	36.03	147.89
深市创业板	95	17.35	35.40
沪市	/	/	/
总计	500	100	627.05

#### 样本股自由流通市值分布 (2015.12.31)

最大	最小	均值	中值
1969.35	18.80	114.49	81.56

### 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
8393.83	2.83%	230.78	518.1	11528.8	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
31457.96	13333.67	30.26%	48.12	39.25	0.56%

#### 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	13.45	515.36	3.87	002673	西部证券	32.91	306.55	2.30
002450	康得新	38.10	448.89	3.37	002230	科大讯飞	37.05	294.18	2.21
002415	海康威视	34.39	427.02	3.20	002183	怡亚通	46.06	285.28	2.14
002202	金风科技	22.79	338.02	2.54	002304	洋河股份	68.54	262.13	1.97
002594	比亚迪	64.40	316.53	2.37	002142	宁波银行	15.51	259.59	1.95

#### 涨幅前 5 名样本股

代码	简称	收盘	涨幅%	贡献点数
002292	奥飞动漫	51.71	49.88	40.70
002202	金风科技	22.79	39.56	60.32
002153	石基信息	151	21.87	17.31
002456	欧菲光	31.02	20.65	19.66
002428	云南锗业	20.28	20.28	8.99

#### 跌幅前 5 名样本股

代码	简称	收盘	涨幅%	贡献点数
002368	太极股份	67.1	-31.88	2.04
002310	东方园林	26.46	-30.91	-31.05
002092	中泰化学	8.8	-24.91	-17.41
002191	劲嘉股份	15.36	-20.08	-19.42
002063	远光软件	21.14	-20.02	-13.79

#### 行业分布 (2015.12.31)

行业	家数	权重 (%)	贡献点数
信息技术	27	30.06	54.77
工业	16	14.35	47.29
可选消费	11	12.53	66.94
原材料	12	12.46	27.50
医药卫生	15	11.86	11.45
金融地产	7	9.02	-9.08
主要消费	7	5.58	25.61
电信业务	4	3.28	4.45
能源	1	0.85	1.85
公用事业	/	/	/
总计	100	100	230.78

#### 市场分布 (2015.12.31)

市场	家数	权重 (%)	贡献点数
深市主板	/	/	/
深市中小板	100	100.00	230.78
创业板	/	/	/
沪市	/	/	/
总计	100	100	230.78

#### 样本股自由流通市值分布 (2015.12.31)

最大	最小	均值	中值
515.36	41.88	133.34	105.07

### 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
2714.05	1.55%	41.47	354.43	10609.55	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
23944.72	10456.11	42.82%	105.06	94.38	0.21%

#### 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	52.03	545.69	5.22	300017	网宿科技	59.99	259.48	2.48
300104	乐视网	58.80	533.88	5.11	300168	万达信息	33.13	208.18	1.99
300027	华谊兄弟	41.48	324.30	3.10	300058	蓝色光标	14.73	177.25	1.70
300024	机器人	68.50	311.63	2.98	300003	乐普医疗	38.60	162.52	1.55
300070	碧水源	51.77	274.20	2.62	300124	汇川技术	47.20	162.22	1.55

#### 涨幅前 5 名样本股

代码	简称	收盘	涨幅%	贡献点数
300020	银江股份	24.52	74.89	10.78
300288	朗玛信息	61.72	48.44	5.89
300178	腾邦国际	29.1	42.93	6.06
300134	大富科技	30.1	31.15	4.06
300352	北信源	62.4	29.81	4.68

#### 跌幅前 5 名样本股

代码	简称	收盘	涨幅%	贡献点数
300152	科融环境	11.21	-19.00	-3.29
300033	同花顺	71.05	-12.27	-4.55
300053	欧比特	40.75	-11.99	-2.22
300202	聚龙股份	32.19	-11.03	-2.31
300295	三六五网	49.6	-10.23	-1.73

#### 行业分布 (2015.12.31)

行业	家数	权重 (%)	贡献点数
信息技术	44	45.37	26.49
工业	17	17.95	1.53
可选消费	11	12.23	10.48
医药卫生	14	12.19	-2.09
电信业务	8	7.51	5.08
原材料	3	2.15	-1.68
主要消费	2	2.09	2.06
能源	1	0.53	-0.41
金融地产	/	/	/
公用事业	/	/	/
总计	100	100.00	41.47

#### 市场分布 (2015.12.31)

市场	家数	权重 (%)	贡献点数
深市主板	/	/	/
中小板	/	/	/
创业板	100	100.00	41.47
沪市	/	/	/
总计	100	100.00	41.47

#### 样本股自由流通市值分布 (2015.12.31)

最大	最小	均值	中值
545.69	27.72	104.56	88.05

**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
4354.86	8.83%	353.4	1165.07	18718.97	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
54348.26	25752.66	23.12%	30.5	26.56	1.00%

**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	24.43	1969.35	7.65	300059	东方财富	52.03	545.69	2.12
000651	格力电器	22.35	967.58	3.76	300104	乐视网	58.80	533.88	2.07
000001	平安银行	11.99	713.80	2.77	000776	广发证券	19.45	532.49	2.07
000725	京东方A	2.97	659.85	2.56	002024	苏宁云商	13.45	515.36	2.00
000333	美的集团	32.82	633.32	2.46	000858	五 粮 液	27.28	454.81	1.77

**涨幅前 5 名样本股**

代码	简称	收盘	涨幅%	贡献点数
000002	万 科A	24.43	62.11	127.91
002292	奥飞动漫	51.71	49.88	10.96
002202	金风科技	22.79	39.56	16.24
000012	南 玻A	13.35	34.17	6.23
000878	云南铜业	13.85	24.77	3.59

**跌幅前 5 名样本股**

代码	简称	收盘	涨幅%	贡献点数
000839	中信国安	20.35	-13.66	-5.10
000413	东旭光电	9.08	-12.02	-3.54
000009	中国宝安	17.96	-10.20	-4.20
300059	东方财富	52.03	-8.25	-8.31
002673	西部证券	32.91	-8.18	-4.62

**行业分布 (2015. 12.31)**

行业	家数	权重 (%)	贡献点数
金融地产	18	26.23	141.07
可选消费	16	20.58	80.68
信息技术	18	18.39	28.72
工业	12	9.98	25.93
主要消费	10	7.57	26.59
原材料	12	7.14	27.62
医药卫生	8	5.40	14.99
电信业务	3	3.44	0.88
能源	2	0.78	0.79
公用事业	1	0.48	-0.73
总计	100	100	353.4

**市场分布 (2015. 12.31)**

市场	家数	权重 (%)	贡献点数
深市主板	59	62.46	275.39
中小板	29	25.13	56.87
创业板	12	12.41	14.27
沪市	/	/	/
总计	100	100	353.4

**样本股自由流通市值分布 (2015. 12.31)**

最大	最小	均值	中值
1969.35	74.38	257.53	193.19



**Index Statistics Report December 2015**
**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
4387.27	4.22%	177.81	6658.08	99432.16	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
359812.69	142663.73	68.01%	20.11	19.83	1.56%

**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	36.00	3553.18	2.49	600000	浦发银行	18.27	1902.32	1.33
600016	民生银行	9.64	2561.17	1.80	600030	中信证券	19.35	1406.74	0.99
601166	兴业银行	17.07	2181.11	1.53	601328	交通银行	6.44	1293.84	0.91
600036	招商银行	17.99	2153.24	1.51	600837	海通证券	15.82	1215.63	0.85
000002	万 科A	24.43	1969.35	1.38	601288	农业银行	3.23	1158.33	0.81

**涨幅前 5 名样本股**

代码	简称	收盘	涨幅%	贡献点数
300020	银江股份	24.52	74.89	1.28
600085	同仁堂	44.61	67.77	3.62
000002	万 科A	24.43	62.11	23.21
600756	浪潮软件	51.43	59.18	1.28
600767	运盛医疗	20.47	50.29	0.61

**跌幅前 5 名样本股**

代码	简称	收盘	涨幅%	贡献点数
000519	江南红箭	16.98	-34.84	-0.21
600058	五矿发展	22.7	-32.40	-1.34
002368	太极股份	67.1	-31.88	0.10
002310	东方园林	26.46	-30.91	-1.52
600110	中科英华	9.65	-29.72	-1.37

**行业分布 (2015. 12.31)**

行业	家数	权重 (%)	贡献点数
金融地产	114	29.12	81.22
工业	221	18.16	2.37
信息技术	136	11.77	16.07
可选消费	126	11.37	30.72
原材料	150	9.46	12.92
医药卫生	83	6.56	17.52
主要消费	58	5.20	16.47
公用事业	39	3.21	-3.59
能源	41	2.58	-0.73
电信业务	32	2.57	3.58
总计	1000	100	177.81

**市场分布 (2015. 12.31)**

市场	家数	权重 (%)	贡献点数
深市主板	199	18.81	61.88
中小板	206	14.11	20.47
创业板	83	6.29	6.08
沪市	512	60.78	88.13
总计	1000	100	177.81

**样本股自由流通市值分布 (2015. 12.31)**

最大	最小	均值	中值
3553.18	18.14	142.66	85.68

## 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红荔西路上步工业区203栋5楼

邮编：518028

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)