

## 2016 年 2 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

2016 年 2 月份，市场呈现普遍下跌行情。核心指数中，国证 1000 指数跌幅较少，本月跌幅为-2.33%。

行业指数方面，深证行业指数中，深成能源指数本月上涨 4.71%，在深证行业指数中表现最佳。国证行业指数中，国证农牧指数本月上涨 3.68%，表现最佳。

主题指数方面，深证系列主题指数中，深证大宗商品指数本月微涨 1.69%。国证主题系列指数中，国证有色指数表现较好，上涨 8.6%。

人民币系列指数中，人民币指数和人民币实际指数均微涨 1.1%，近一年涨跌幅则分别为-0.11%和 0.11%。

<b>深证系列指数</b>		<b>2016 年 2 月收益表现最佳指数</b>			
指数代码	指数简称	近 1 个月	近 3 个月	近 6 个月	近 1 年
399680	深成能源指数	4.71%	-16.09%	-20.84%	-19.06%

  

<b>国证系列指数</b>		<b>2016 年 2 月收益表现最佳指数</b>			
指数代码	指数简称	近 1 个月	近 3 个月	近 6 个月	近 1 年
399395	国证有色指数	8.60%	-16.72%	-10.18%	-23.72%

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	-3.41%	-24.43%	-13.76%	-22.63%	53.62%
399005	中小板指	-4.38%	-26.52%	-15.91%	-9.54%	52.84%
399006	创业板指	-5.71%	-29.65%	-5.85%	-2.48%	59.87%
399007	深证 300	-3.66%	-23.16%	-14.46%	-14.43%	52.34%
399008	中小板 300	-3.48%	-27.60%	-14.33%	-5.53%	55.93%
399009	深证 200	-3.59%	-28.66%	-17.48%	-10.83%	56.47%
399010	深证 700	-2.46%	-27.91%	-9.88%	3.03%	59.69%
399011	深证 1000	-3.15%	-25.25%	-12.53%	-7.55%	55.36%
399012	创业板 300	-5.82%	-30.47%	-6.27%	4.41%	62.34%
399015	中小创新	-2.42%	-27.55%	-9.17%	4.80%	60.61%
399330	深证 100	-3.71%	-18.80%	-12.14%	-16.69%	49.74%
399612	中创 100	-5.65%	-26.79%	-13.54%	-9.20%	54.40%
399623	中小基础	-3.01%	-26.89%	-11.65%	-1.30%	56.54%
399624	中创 400	-2.88%	-29.43%	-10.03%	1.20%	60.23%
399625	中创 500	-4.03%	-28.37%	-11.51%	-3.37%	57.67%
399640	创业基础	-5.75%	-30.35%	-6.76%	2.59%	62.11%

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	-2.47%	-25.97%	-6.06%	11.24%	59.49%
399310	国证 50	-1.61%	-13.17%	-8.97%	-17.54%	35.91%
399311	国证 1000	-2.33%	-23.05%	-15.99%	-17.06%	49.19%
399312	国证 300	-2.36%	-19.69%	-15.19%	-19.96%	44.90%
399313	巨潮 100	-1.99%	-16.12%	-11.69%	-20.13%	39.98%
399314	巨潮大盘	-2.61%	-18.71%	-13.44%	-20.30%	42.92%
399315	巨潮中盘	-2.47%	-27.19%	-21.52%	-17.62%	54.77%
399316	巨潮小盘	-1.50%	-28.34%	-15.77%	-6.57%	59.75%
399400	大中盘指	-2.57%	-21.41%	-16.00%	-19.61%	46.34%
399401	中小盘指	-2.00%	-27.75%	-18.80%	-12.48%	57.16%

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	95878.68	42884.45	56.45%	33.35	29.85	0.88%	9.49%
399005	中小板指	24854.38	10218.28	33.42%	38.20	30.44	0.76%	11.07%
399006	创业板指	17525.06	7576.65	45.17%	77.52	68.03	0.28%	8.76%
399330	深证 100	42729.83	19348.21	25.16%	24.15	20.77	1.25%	10.96%
399007	深证 300	74553.73	33293.54	43.89%	30.30	26.90	0.98%	9.96%
399009	深证 200	31823.91	13945.33	18.74%	46.04	44.64	0.63%	8.07%
399010	深证 700	55795.40	24583.11	32.85%	55.16	55.88	0.49%	6.61%
399011	深证 1000	130349.14	57876.65	76.74%	37.54	34.58	0.77%	8.68%
399008	中小板 300	44722.49	18827.26	60.14%	43.77	36.96	0.67%	9.34%
399012	创业板 300	29898.69	12738.95	77.07%	77.82	70.72	0.29%	7.61%
399015	中小创新	34470.46	14992.20	20.29%	57.75	61.88	0.49%	6.14%
399612	中创 100	29407.23	12069.17	25.99%	41.72	33.58	0.65%	11.19%
399625	中创 500	69726.03	29517.20	61.61%	51.58	44.21	0.55%	8.92%
399624	中创 400	40318.80	17448.04	35.63%	62.34	57.49	0.47%	7.30%
399310	国证 50	110804.68	33683.66	28.04%	8.73	8.83	3.51%	13.02%
399313	巨潮 100	139376.08	44731.26	35.27%	9.94	9.85	3.10%	12.61%
399312	国证 300	198509.97	69426.65	50.23%	12.39	12.10	2.52%	11.79%
399311	国证 1000	285460.47	108729.97	72.24%	15.77	15.48	1.98%	10.98%
399314	巨潮大盘	174709.01	59458.71	44.21%	11.44	11.18	2.70%	12.16%
399315	巨潮中盘	57730.39	25256.27	14.61%	35.97	36.28	0.97%	7.23%
399316	巨潮小盘	53021.07	24014.99	13.42%	43.34	43.10	0.71%	7.22%
399400	大中盘	232439.40	84714.98	58.82%	13.77	13.50	2.27%	11.41%
399401	中小盘	110751.46	49271.26	28.03%	39.15	39.25	0.85%	7.22%
399303	国证 2000	100156.55	39502.96	25.34%	66.17	72.84	0.46%	5.86%

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	3.38%	-19.00%	-16.96%	-19.79%	64.77%
399614	深证材料指数	-0.09%	-23.64%	-15.94%	-8.59%	56.11%
399615	深证工业指数	-5.22%	-30.60%	-21.45%	-12.45%	60.75%
399616	深证可选消费	-1.89%	-23.06%	-17.33%	-10.98%	54.15%
399617	深证主要消费	-1.84%	-14.59%	-9.31%	-3.17%	45.12%
399618	深证医药卫生	-2.91%	-24.26%	-16.54%	-6.35%	52.25%
399619	深证金融地产	-4.71%	-15.45%	2.76%	-15.77%	46.75%
399620	深证信息技术	-4.20%	-28.16%	-7.74%	-10.00%	57.54%
399621	深证电信指数	-7.99%	-29.05%	-6.55%	-0.10%	57.45%
399622	深证公用事业	-1.62%	-35.51%	-29.66%	-23.56%	61.88%
399674	深 A 医药卫生	-3.16%	-24.34%	-11.74%	0.37%	53.47%
399675	深 A 软件与互联网	-6.74%	-31.17%	-0.86%	-5.84%	62.49%
399680	深成能源指数	4.71%	-16.09%	-20.84%	-19.06%	65.78%
399681	深成材料指数	-0.47%	-22.82%	-15.38%	-11.80%	55.83%
399682	深成工业指数	-5.52%	-30.67%	-23.64%	-15.92%	60.49%
399683	深成可选指数	-2.40%	-23.26%	-18.75%	-14.68%	54.63%
399684	深成消费指数	-1.32%	-10.82%	-7.13%	-1.15%	42.14%
399685	深成医药指数	-2.53%	-22.96%	-14.41%	-3.74%	50.92%
399686	深成金融指数	-4.24%	-17.09%	-0.95%	-13.62%	46.37%
399687	深成信息指数	-4.31%	-28.42%	-7.96%	-8.23%	57.85%
399688	深成电信指数	-8.14%	-28.80%	-10.47%	-5.61%	54.84%
399689	深成公用指数	-0.85%	-35.92%	-31.87%	-28.08%	62.76%

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	1.73%	-15.78%	-19.48%	-24.43%	53.40%
399382	国证 1000 材料	2.06%	-22.18%	-15.83%	-19.26%	56.67%
399383	国证 1000 工业	-4.06%	-30.49%	-28.61%	-21.95%	56.62%
399384	国证 1000 可选	-2.87%	-24.20%	-19.48%	-15.33%	52.43%
399385	国证 1000 消费	-0.53%	-13.42%	-12.19%	-5.69%	42.90%
399386	国证 1000 医药	-2.34%	-21.27%	-13.68%	-3.29%	50.54%
399387	国证 1000 金融	-2.24%	-16.44%	-6.11%	-18.43%	40.34%
399388	国证 1000 信息	-4.04%	-28.54%	-8.76%	-12.21%	57.40%
CN5110	国证 1000 电信	-5.30%	-29.72%	-16.58%	-14.36%	56.12%
399390	国证 1000 公用	-1.66%	-29.13%	-30.96%	-21.35%	48.81%
399431	国证银行指数	-0.99%	-10.80%	-5.41%	-4.43%	26.08%

399432	国证汽车指数	-0.85%	-21.45%	-9.62%	-16.30%	51.33%
399433	国证交运指数	-3.80%	-30.55%	-31.95%	-17.90%	52.14%
399434	国证传媒指数	-7.45%	-37.07%	-32.94%	-28.71%	63.96%
399435	国证农牧指数	3.68%	-15.94%	-9.35%	4.05%	50.92%
399436	国证煤炭指数	3.20%	-10.36%	-12.84%	-15.29%	64.48%
399437	国证证券指数	-5.28%	-26.60%	-6.33%	-46.05%	62.60%
399438	国证电力指数	-1.96%	-28.72%	-33.72%	-15.82%	47.35%
399439	国证油气指数	0.45%	-17.59%	-16.33%	-28.76%	42.60%
399440	国证钢铁指数	0.03%	-21.85%	-32.85%	-25.59%	65.06%
CN5073	国证能源指数	1.74%	-16.56%	-19.46%	-23.57%	53.21%
CN5074	国证非银指数	-4.74%	-23.50%	-8.12%	-39.16%	52.40%
CN5075	国证软件指数	-7.28%	-31.65%	-5.65%	-18.55%	61.40%
CN5076	国证生科指数	-3.20%	-22.80%	-15.50%	10.94%	56.88%
CN5077	国证电影指数	-8.73%	-33.65%	-18.18%	-8.71%	59.49%
CN5078	国证家电指数	-2.89%	-14.99%	-12.29%	-10.73%	46.70%
CN5079	国证中药指数	-3.75%	-23.92%	-17.22%	-10.88%	51.44%
CN5080	国证建材指数	1.95%	-22.41%	-23.77%	-24.64%	57.85%
CN5081	国证白酒指数	0.49%	-7.21%	-1.40%	5.98%	38.72%
CN5082	国证航天指数	-5.26%	-28.86%	-30.87%	-17.54%	68.89%
CN5083	国证半导指数	-2.46%	-28.87%	0.02%	-4.34%	53.65%
CN5084	电信服务指数	-2.61%	-28.95%	-16.02%	-17.54%	57.88%
CN5085	服装纺织指数	0.20%	-25.91%	-19.24%	7.18%	57.88%
CN5086	工业服务指数	-3.15%	-27.63%	-24.17%	-19.57%	54.34%
CN5087	工业用品指数	-4.47%	-31.44%	-25.35%	-17.79%	60.60%
CN5088	国证公用指数	-1.69%	-29.06%	-31.52%	-19.73%	48.78%
CN5089	国证材料指数	3.65%	-20.40%	-17.07%	-21.09%	58.61%
CN5090	国证化工指数	-1.49%	-26.30%	-11.38%	-3.60%	54.10%
CN5091	电脑硬件指数	-1.83%	-26.87%	-11.53%	-4.06%	56.80%
CN5092	国证家用指数	-3.57%	-22.68%	-2.67%	-11.23%	59.24%
CN5093	国证零售指数	-3.18%	-25.79%	-18.74%	-6.01%	54.51%
CN5094	耐用消费指数	-2.55%	-17.79%	-13.09%	-5.73%	46.69%
CN5095	食品零售指数	-4.59%	-21.22%	-17.28%	-11.48%	51.92%
CN5096	国证通信指数	-5.70%	-28.23%	-10.19%	-5.08%	55.37%
CN5097	消费服务指数	-1.99%	-18.15%	-6.51%	-4.40%	52.20%
CN5098	国证医疗指数	-4.49%	-29.16%	-5.55%	-3.23%	51.96%
CN5099	国证制药指数	-1.90%	-20.60%	-12.94%	-4.18%	49.96%
CN5100	白色家电指数	-4.76%	-9.64%	-6.67%	-10.87%	40.24%
CN5101	国证百货指数	-4.88%	-28.51%	-21.89%	-5.19%	60.28%
CN5102	国证空运指数	-6.04%	-24.55%	-26.13%	-6.21%	54.85%
CN5103	网络软件指数	-5.79%	-26.49%	12.50%	-9.10%	52.49%
CN5104	建筑工程指数	-3.22%	-28.44%	-27.71%	-26.18%	58.72%
CN5105	路桥港口指数	-6.21%	-23.93%	-22.22%	-17.23%	43.14%
CN5106	酒店餐饮指数	-1.20%	-17.14%	-5.65%	11.10%	49.27%

CN5107	国证水务指数	2.65%	-25.25%	-12.54%	-30.97%	55.20%
CN5108	国证机械指数	-5.49%	-30.52%	-19.77%	-16.29%	62.79%

## 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	-3.71%	-18.63%	-6.74%	-7.94%	46.78%
399348	深证 300 价值	-2.57%	-15.20%	-10.38%	-13.81%	47.13%
399628	深证 700 成长	-2.58%	-29.11%	-9.07%	2.38%	59.55%
399629	深证 700 价值	-1.22%	-25.37%	-11.24%	3.33%	58.73%
399630	深证 1000 成长	-3.94%	-22.66%	-9.21%	-5.86%	51.30%
399631	深证 1000 价值	-1.98%	-19.58%	-11.82%	-9.07%	51.15%
399602	中小 300 成长	-4.24%	-25.80%	-17.25%	-7.11%	52.15%
399604	中小 300 价值	-2.34%	-26.07%	-15.46%	-12.14%	56.74%
399667	创业 300 成长	-5.76%	-28.80%	-5.61%	-2.91%	59.51%
399668	创业 300 价值	-5.74%	-28.94%	-3.01%	11.86%	61.79%
399626	中创 500 成长	-4.78%	-26.68%	-11.47%	-6.29%	54.49%
399627	中创 500 价值	-3.72%	-27.06%	-13.86%	-8.44%	58.01%

**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	-2.07%	-20.69%	-12.15%	-10.83%	48.45%
399371	国证 1000 价值	-1.23%	-16.55%	-13.05%	-11.96%	39.83%
399372	1000 大盘成长	-1.82%	-14.70%	-7.47%	-9.68%	41.97%
399373	1000 大盘价值	-1.49%	-11.36%	-8.50%	-11.23%	32.45%
399374	1000 中盘成长	-3.40%	-26.39%	-19.19%	-16.43%	53.28%
399375	1000 中盘价值	-1.04%	-24.98%	-23.12%	-14.00%	51.37%
399376	1000 小盘成长	-1.24%	-27.48%	-14.11%	-4.97%	59.16%
399377	1000 小盘价值	-0.41%	-24.83%	-17.11%	-11.21%	56.67%

## 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	-2.31%	-7.03%	-3.10%	-10.58%	41.63%
399328	深证治理指数	-1.80%	-6.79%	-3.38%	-3.59%	39.03%
399653	深证龙头指数	-2.52%	-9.45%	-2.68%	-2.78%	39.98%
399341	深证责任指数	-1.61%	-12.39%	-6.26%	-6.76%	45.17%
399670	深证周期 50	-3.00%	-18.59%	-8.31%	-21.77%	52.28%



399335	深证央企指数	-2.23%	-13.66%	-9.98%	-5.97%	45.77%
399646	深证消费 50	-2.95%	-19.21%	-18.63%	-14.71%	50.53%
399637	深证地产指数	-0.27%	-20.58%	-10.80%	0.57%	52.29%
399669	深证农业指数	-3.06%	-17.99%	-11.54%	-5.87%	46.69%
399332	深证创新指数	-4.17%	-20.35%	-16.06%	-20.09%	51.64%
399013	深市精选指数	-3.08%	-23.32%	-14.23%	-13.12%	52.65%
399651	中小责任指数	-2.25%	-22.02%	-13.42%	-4.49%	52.24%
399639	深证大宗商品	1.69%	-17.10%	-16.28%	-14.37%	53.97%
399649	中小红利指数	-3.83%	-23.84%	-11.94%	-4.79%	48.70%
399636	深证装备指数	-6.11%	-30.53%	-21.01%	-16.11%	59.36%
399337	深证民营指数	-4.75%	-25.80%	-13.88%	-15.48%	54.21%
399641	深证新兴产业	-4.59%	-26.99%	-13.07%	-10.19%	56.48%
399654	深证文化指数	-5.48%	-28.79%	-17.88%	-7.22%	55.49%
399642	中小新兴产业	-5.27%	-28.16%	-13.55%	-6.72%	56.98%
399647	深证医药 50	-2.54%	-22.42%	-14.08%	-2.08%	49.71%
399671	深证防御 50	-6.02%	-25.45%	-20.95%	-11.74%	49.06%
399608	深证科技 100	-5.54%	-27.25%	-10.63%	-4.83%	55.34%
399610	深证 TMT50	-6.01%	-28.14%	-15.79%	-14.07%	57.34%
399339	深证科技指数	-5.03%	-26.37%	-10.80%	-9.67%	55.20%
399652	中创高新指数	-6.61%	-27.64%	4.49%	10.11%	55.25%
399650	中小治理指数	-2.05%	-24.81%	-15.71%	-10.15%	52.56%
399643	创业新兴产业	-5.49%	-30.63%	-5.30%	1.34%	62.25%
399638	深证环保指数	-3.93%	-30.94%	-17.63%	-10.68%	61.95%
399678	深证次新股指数	-5.32%	-36.33%	8.22%	16.41%	67.75%

**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	-0.29%	-12.70%	-1.38%	0.67%	48.08%
399367	巨潮地产指数	-0.07%	-11.98%	-1.31%	3.16%	46.48%
399396	国证食品指数	-1.41%	-14.22%	-11.29%	-5.24%	43.11%
399322	国证治理指数	-1.35%	-11.25%	-6.51%	-9.35%	33.99%
399321	国证红利指数	-0.95%	-10.92%	-7.02%	-14.24%	34.04%
399365	国证农业指数	-1.62%	-15.11%	-13.71%	-8.90%	43.40%
399402	国证周期 100	-1.80%	-18.75%	-9.81%	-29.04%	49.27%
399420	国证保证指数	-5.07%	-24.81%	-7.09%	-41.78%	56.69%
399389	国证 1000 电信	-5.16%	-27.69%	-9.17%	-2.35%	56.53%
399361	国证商业连锁	-2.87%	-23.80%	-20.36%	-8.83%	52.24%
399394	国证医药指数	-2.34%	-21.90%	-12.53%	-0.74%	50.79%
399441	国证生物医药	-2.94%	-22.26%	-14.86%	11.68%	54.27%
399412	国证新能指数	-1.51%	-29.08%	-11.74%	-8.38%	63.76%
399403	国证防御 100	-3.51%	-22.65%	-18.36%	-13.64%	48.46%
399395	国证有色指数	8.60%	-16.72%	-10.18%	-23.72%	60.66%

## Index Statistics Report February 2016

399362	国证民营指数	-3.63%	-24.46%	-15.10%	-15.54%	48.88%
399419	国证高铁指数	-4.45%	-28.70%	-18.61%	-19.34%	61.74%
399363	国证计算机指数	-4.87%	-29.51%	-8.39%	-14.49%	57.43%
399428	国证定向增发	-0.15%	-26.82%	-6.91%	5.01%	58.71%
399319	国证资源优势	5.17%	-15.96%	-14.40%	-23.31%	55.50%
399366	国证大宗商品	3.00%	-17.10%	-16.66%	-23.41%	53.72%
399418	国证国家安全	-3.19%	-27.92%	-20.53%	-14.18%	59.42%
399392	国证新兴产业	-4.64%	-27.53%	-18.55%	-13.23%	56.07%
399353	国证物流指数	-4.37%	-27.70%	-30.54%	-17.25%	50.39%
399360	国证装备指数	-5.78%	-30.93%	-31.54%	-26.59%	59.45%
399359	国证基建指数	-3.07%	-27.87%	-29.92%	-23.83%	50.03%
399320	国证服务指数	-4.13%	-31.69%	-32.47%	-21.07%	51.98%
399368	国证航天军工	-5.15%	-30.79%	-28.00%	-13.47%	58.71%

## 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	-3.81%	-15.69%	-7.86%	-14.49%	41.01%
399355	长三角指数	-1.68%	-21.84%	-11.89%	-21.43%	47.50%
399356	珠三角指数	-3.41%	-13.59%	-6.61%	-14.84%	41.35%
399357	环渤海指数	-2.27%	-16.37%	-16.52%	-18.62%	37.14%
CN6019	宁夏指数	3.01%	-26.95%	-4.05%	9.94%	57.39%
CN6029	云南指数	1.73%	-21.23%	-14.64%	-16.71%	56.12%
CN6007	贵州指数	0.80%	-17.95%	-6.53%	-2.77%	47.35%
CN6022	山西指数	0.13%	-19.29%	-15.25%	-24.38%	56.17%
CN6020	青海指数	0.02%	-17.00%	-4.46%	-20.33%	50.81%
CN6017	辽宁指数	-3.83%	-27.28%	-15.93%	-10.97%	59.90%
CN6014	吉林指数	-3.84%	-27.39%	-17.22%	-12.32%	52.62%
CN6031	重庆指数	-4.04%	-25.43%	-14.30%	-16.08%	59.10%
CN6011	黑龙江指	-4.96%	-31.96%	-26.29%	-16.08%	59.70%
CN6023	陕西指数	-5.03%	-29.95%	-21.10%	-13.95%	61.59%

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	-3.57%	-22.81%	-16.20%	-16.60%	54.80%



399633	深证 300 等权	-3.15%	-26.47%	-16.05%	-12.14%	56.43%
399634	中小板等权指数	-4.04%	-27.72%	-15.57%	-7.50%	54.20%
399635	创业板等权指数	-5.43%	-31.14%	-4.25%	2.62%	63.01%
399645	深证 100 低波	-2.83%	-19.17%	-16.45%	-12.75%	50.25%
399655	深证绩效指数	-2.64%	-23.41%	-11.57%	-5.09%	54.04%
399656	深证 100 绩效	-2.89%	-18.64%	-11.85%	-10.32%	50.84%
399657	深证 300 绩效	-3.55%	-25.02%	-14.67%	-10.30%	54.30%
399658	中小板指绩效	-4.48%	-27.80%	-16.89%	-9.87%	53.71%
399659	深证成份等权	-2.94%	-27.19%	-13.91%	-17.89%	57.51%
399660	中创 100 等权	-5.30%	-27.86%	-14.49%	-9.43%	56.34%
399661	深证 300 低波	-2.98%	-22.30%	-16.02%	-10.64%	49.23%
399662	深证 300 高贝	-3.56%	-29.19%	-15.42%	-13.49%	61.19%
399663	中小 300 低波	-2.71%	-27.20%	-16.67%	-7.29%	53.87%
399664	中小 300 高贝	-4.33%	-30.49%	-12.20%	2.58%	62.28%
399665	中创 500 低波	-3.04%	-26.71%	-13.00%	-1.17%	56.47%
399666	中创 500 高贝	-4.12%	-29.52%	-7.08%	3.76%	62.86%
399672	深红利 50 指数	-1.17%	-19.24%	-14.43%	-3.19%	51.46%
399673	创业板 50 指数	-7.85%	-30.00%	-5.54%	-6.05%	60.46%
399676	深 A 医药卫生等权	-3.40%	-25.36%	-8.18%	7.97%	57.04%
399677	深 A 软件与互联网等权	-6.48%	-32.87%	0.96%	4.90%	67.20%

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
399354	分析师指	-2.40%	-14.59%	-8.64%	-9.00%	38.35%
399398	绩效指数	-1.21%	-20.77%	-12.59%	-10.12%	48.37%
399404	大盘低波	-1.91%	-13.45%	-10.39%	-7.48%	34.56%
399405	大盘高贝	-4.40%	-25.93%	-15.11%	-29.66%	59.50%
399406	中盘低波	-2.38%	-22.76%	-17.35%	-3.05%	50.59%
399407	中盘高贝	-1.95%	-30.25%	-21.87%	-20.38%	60.93%
399408	小盘低波	-0.71%	-23.77%	-14.10%	-2.60%	55.72%
399409	小盘高贝	-1.92%	-30.87%	-13.33%	-8.62%	64.43%
399411	红利 100	-0.62%	-18.13%	-12.21%	-8.05%	44.54%
399427	专利领先	-1.10%	-28.81%	-5.99%	4.36%	61.26%

## 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	-4.70%	-21.70%	-11.43%	-8.73%	51.33%
399358	泰达环保指数	-3.21%	-28.18%	-20.22%	-19.37%	53.35%
399364	中金龙头消费	-2.50%	-19.22%	-16.91%	-12.87%	47.77%
399369	CBN-兴业责任	-1.02%	-16.37%	-12.72%	-18.01%	43.31%
399378	南方低碳指数	-3.39%	-19.70%	-14.29%	-12.20%	46.50%
399391	国证投资时钟	0.03%	-8.64%	-6.62%	-5.21%	38.19%
399644	深证投资时钟	-0.81%	-9.66%	-2.82%	-7.61%	43.31%
399648	深证 GDP100	-1.84%	-17.38%	-18.91%	-6.90%	46.96%
399397	华侨城文化	-5.70%	-28.37%	-18.97%	-14.87%	56.36%
399399	中经 GDP 指数	-1.71%	-19.06%	-12.12%	-15.01%	45.70%
399350	国元皖江 30	-1.97%	-26.97%	-16.38%	-12.61%	55.58%
399410	苏州率先指数	-3.80%	-29.31%	-11.46%	-14.22%	61.56%
CN5061	深证 GDP 对冲	1.80%	1.24%	-8.78%	8.47%	6.01%
CN5062	中经 GDP 对冲	0.58%	0.23%	2.63%	5.09%	2.78%
399415	大数据 100 指数	-4.24%	-23.00%	-7.48%	8.98%	53.50%
399416	大数据 300 指数	-2.19%	-15.75%	-2.65%	-6.09%	40.90%
399429	新丝路指数	-3.57%	-28.30%	-19.74%	-18.09%	58.71%
399423	中关村 50 指数	-4.79%	-27.01%	-17.03%	-16.31%	52.04%
CN5069	中关村 A 指	-4.78%	-28.96%	-13.88%	-8.30%	54.92%

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	-2.44%	-12.78%	-6.33%	-10.58%	40.41%
399551	央视创新指数	-3.87%	-24.07%	-9.54%	-9.21%	52.18%
399552	央视成长指数	-2.39%	-10.77%	-7.28%	-9.38%	36.77%
399553	央视回报指数	-2.85%	-16.88%	-9.20%	-13.00%	46.77%
399554	央视治理指数	-1.75%	-12.02%	-3.66%	-9.13%	37.31%
399555	央视责任指数	-3.03%	-17.41%	-10.80%	-13.99%	35.77%
399556	央视生态指数	-2.89%	-26.22%	-18.35%	-12.52%	53.78%
399557	央视文化指数	-5.14%	-29.41%	-17.04%	-13.95%	57.25%

## 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	1.10%	-1.36%	0.01%	-0.11%	4.47%
CNYR	人民币实际指数	1.10%	-0.45%	-0.49%	0.11%	4.51%

## 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	0.31%	-9.50%	-2.92%	-31.58%	22.02%
399307	深证转债指数	-3.05%	-16.04%	-0.07%	-3.09%	27.62%
399298	深信中高信用	0.23%	1.70%	2.89%	7.45%	0.75%
399299	深信中低信用	0.29%	1.68%	2.93%	7.87%	0.65%
399301	深证信用债	0.28%	1.75%	2.97%	7.64%	0.60%
399302	深证公司债	0.24%	1.77%	2.92%	7.62%	0.60%
399481	国证企业指数	0.11%	0.88%	1.19%	2.48%	0.28%
CNB001	国证利率	0.23%	1.76%	3.34%	5.90%	0.98%
CNB002	国证国债	0.36%	1.64%	3.19%	5.53%	0.89%
CNB003	国证政金	0.13%	1.83%	3.45%	6.14%	1.14%
CNB101	国证利率(净价)	-0.08%	0.84%	1.46%	1.94%	0.96%
CNB102	国证国债(净价)	0.09%	0.82%	1.50%	1.99%	0.85%
CNB103	国证政金(净价)	-0.20%	0.85%	1.43%	1.89%	1.14%
CNB201	国证利率(全价)	-0.05%	0.98%	1.79%	2.41%	1.00%
CNB202	国证国债(全价)	0.13%	0.93%	1.72%	2.41%	0.98%
CNB203	国证政金(全价)	-0.17%	1.02%	1.84%	2.41%	1.15%

## 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	-1.80%	-20.89%	-10.66%	-18.72%	32.50%
399305	基金指数	-0.37%	-13.02%	9.05%	-0.53%	38.59%
399306	深证 ETF	-3.52%	-20.38%	-9.83%	-16.24%	40.01%
399379	国证基金	-1.78%	-19.29%	-10.45%	-17.67%	32.92%

**Index Statistics Report February 2016**

399380	国证 ETF	-2.43%	-19.31%	-12.03%	-17.07%	37.08%
CN6070	中国股基指数	-3.07%	-25.37%	-9.42%	-8.69%	53.78%
CN6071	中国混基指数	-1.29%	-15.71%	-3.02%	10.83%	33.90%
CN6072	中国债基指数	0.28%	0.55%	2.91%	9.41%	2.44%
CN6112	国证货币基金指数	0.22%	0.70%	1.40%	3.33%	0.13%

## 多资产系列指数

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
CN6113	中国年金指数	-0.37%	-4.52%	0.14%	4.52%	12.14%
CN6114	生命周期(20-35)基指	-1.86%	-18.90%	-9.34%	-4.78%	40.41%
CN6115	生命周期(15-20)基指	-1.33%	-13.79%	-5.87%	-1.03%	29.79%
CN6116	生命周期(10-15)基指	-0.79%	-8.59%	-2.51%	2.19%	19.57%
CN6117	生命周期(5-10)基指	-0.25%	-3.41%	0.53%	4.53%	9.68%
CN6118	生命周期(0-5)基指	0.29%	1.76%	3.27%	5.96%	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
9097.36	-3.41%	-320.84	1598.97	22009.67	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
95878.68	42884.45	56.45%	33.35	29.85	0.88%

**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	1305.69	3.04	000333	美的集团	26.07	504.42	1.18
000651	格力电器	19.22	825.89	1.93	002024	苏宁云商	10.28	405.00	0.94
000001	平安银行	9.56	569.14	1.33	000858	五粮液	22.46	374.48	0.87
300104	乐视网	58.80	536.35	1.25	300059	东方财富	33.18	350.92	0.82
000725	京东方A	2.36	525.28	1.22	000776	广发证券	12.80	350.43	0.82

**涨幅前 5 名样本股**

代码	简称	收盘	涨幅%	贡献点数
000807	云铝股份	7.8	36.84	3.49
002001	新和成	19	35.62	4.86
002299	圣农发展	24.38	33.66	4.97
002714	牧原股份	54.06	30.11	3.80
002074	国轩高科	31.75	29.80	3.39

**跌幅前 5 名样本股**

代码	简称	收盘	涨幅%	贡献点数
000973	佛塑科技	8.01	-38.38	-7.58
000901	航天科技	34.3	-35.14	-8.23
002269	美邦服饰	3.98	-34.43	-4.50
002465	海格通信	11.2	-32.89	-16.69
002011	盾安环境	11.79	-29.49	-4.97

**行业分布 (2016.02.29)**

行业	家数	权重 (%)	贡献点数
信息技术	108	21.81	-89.39
可选消费	66	15.42	-34.42
工业	98	14.86	-79.03
金融地产	39	14.19	-57.09
原材料	69	11.49	-4.97
医药卫生	49	8.63	-20.40
主要消费	28	6.46	-7.85
电信业务	21	3.98	-32.13
公用事业	13	1.75	-1.36
能源	9	1.42	5.80
总计	500	100	-320.84

**市场分布 (2016.02.29)**

市场	家数	权重 (%)	贡献点数
深市主板	183	45.35	-112.11
深市中小板	219	37.28	-114.95
深市创业板	98	17.37	-93.79
沪市	/	/	/
总计	500	100	-320.84

**样本股自由流通市值分布 (2016.02.29)**

最大	最小	均值	中值
1305.69	15.99	85.77	60.08

### 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
5998.28	-4.38%	-274.63	264.15	4973.02	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
24854.38	10218.28	33.42%	38.2	30.44	0.76%

#### 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	10.28	405.00	3.96	002736	国信证券	13.50	222.42	2.18
002450	康得新	29.90	347.52	3.40	002202	金风科技	14.46	214.64	2.10
002415	海康威视	27.74	329.63	3.23	002018	华信国际	44.08	207.25	2.03
002304	洋河股份	57.31	286.27	2.80	002065	东华软件	25.10	207.05	2.03
002594	比亚迪	50.51	249.98	2.45	002230	科大讯飞	25.31	201.15	1.97

#### 涨幅前 5 名样本股

#### 跌幅前 5 名样本股

代码	简称	收盘	涨幅%	贡献点数	代码	简称	收盘	涨幅%	贡献点数
002001	新和成	19	35.62	13.46	002269	美邦服饰	3.98	-34.43	-12.45
002299	圣农发展	24.38	33.66	13.75	002465	海格通信	11.2	-32.89	-46.19
002285	世联行	12.56	24.60	8.23	002011	盾安环境	11.79	-29.49	-13.76
002280	联络互动	41.4	19.17	8.21	002368	太极股份	29.64	-24.00	-11.29
002092	中泰化学	6.64	11.41	3.89	002261	拓维信息	25.5	-22.33	-12.55

#### 行业分布 (2016.02.29)

行业	家数	权重 (%)	贡献点数
信息技术	27	29.11	-83.83
工业	16	13.43	-62.68
可选消费	11	12.65	-13.09
医药卫生	15	12.08	-18.97
原材料	10	11.55	-16.25
金融地产	7	8.69	-39.87
主要消费	6	6.53	14.51
电信业务	7	5.28	-52.30
能源	1	0.68	-2.14
公用事业	/	/	/
总计	100	100	-274.63

#### 市场分布 (2016.02.29)

市场	家数	权重 (%)	贡献点数
深市主板	/	/	/
深市中小板	100	100.00	-274.62
创业板	/	/	/
沪市	/	/	/
总计	100	100	-274.63

#### 样本股自由流通市值分布 (2016.02.29)

最大	最小	均值	中值
405.00	22.87	102.18	79.91



**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
1880.15	-5.71%	-113.92	207.61	4797.37	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
17525.06	7576.65	45.17%	77.52	68.03	0.28%

**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%
300104	乐视网	58.80	536.35	7.08	300027	华谊兄弟	22.67	163.04	2.15
300059	东方财富	33.18	350.92	4.63	300168	万达信息	25.16	158.08	2.09
300017	网宿科技	51.91	225.12	2.97	300124	汇川技术	32.01	143.73	1.90
300024	机器人	44.01	200.08	2.64	300003	乐普医疗	30.73	143.30	1.89
300070	碧水源	33.70	186.62	2.46	300408	三环集团	27.27	131.61	1.74

**涨幅前 5 名样本股**

代码	简称	收盘	涨幅%	贡献点数
300226	上海钢联	45.82	24.41	2.30
300142	沃森生物	10.89	17.98	3.83
300113	顺网科技	78.1	15.69	3.85
300347	泰格医药	28.6	12.69	2.02
300498	温氏股份	47.71	10.13	2.79

**跌幅前 5 名样本股**

代码	简称	收盘	涨幅%	贡献点数
300288	朗玛信息	30.68	-16.17	-1.52
300352	北信源	26.67	-16.13	-1.66
300027	华谊兄弟	22.67	-15.97	-7.69
300244	迪安诊断	45.03	-15.04	-3.04
300133	华策影视	18	-14.69	-2.99

**行业分布 (2016.02.29)**

行业	家数	权重 (%)	贡献点数
信息技术	45	47.16	-49.61
工业	18	16.67	-28.11
医药卫生	13	12.43	-3.82
可选消费	12	11.52	-22.48
电信业务	7	7.53	-7.00
主要消费	2	2.54	0.22
原材料	2	1.65	-2.53
能源	1	0.49	-0.60
金融地产	/	/	/
公用事业	/	/	/
总计	100	100	-113.92

**市场分布 (2016.02.29)**

市场	家数	权重 (%)	贡献点数
深市主板	/	/	/
中小板	/	/	/
创业板	100	100.00	-113.92
沪市	/	/	/
总计	100	100.00	-113.92

**样本股自由流通市值分布 (2016.02.29)**

最大	最小	均值	中值
536.35	16.88	75.77	60.14

**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
3249.21	-3.71%	-125.14	591.45	7530.05	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
42729.83	19348.21	25.16%	24.15	20.77	1.25%

**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%
000002	万 科 A	24.43	1305.69	6.75	000333	美的集团	26.07	504.42	2.61
000651	格力电器	19.22	825.89	4.27	002024	苏宁云商	10.28	405.00	2.09
000001	平安银行	9.56	569.14	2.94	000858	五 粮 液	22.46	374.48	1.94
300104	乐 视 网	58.80	536.35	2.77	300059	东方财富	33.18	350.92	1.81
000725	京东方 A	2.36	525.28	2.71	000776	广发证券	12.80	350.43	1.81

**涨幅前 5 名样本股**

代码	简称	收盘	涨幅%	贡献点数
000060	中金岭南	11.50	27.07	5.20
000629	攀钢钒钛	3.30	22.68	3.64
000031	中粮地产	10.56	10.46	1.66
002292	奥飞动漫	33.97	10.29	2.14
300498	温氏股份	47.71	10.13	1.89

**跌幅前 5 名样本股**

代码	简称	收盘	涨幅%	贡献点数
002465	海格通信	11.20	-32.89	-13.21
002673	西部证券	19.22	-20.41	-7.82
300027	华谊兄弟	22.67	-15.97	-5.21
000686	东北证券	11.28	-15.57	-3.93
300070	碧 水 源	33.70	-14.14	-5.16

**行业分布 (2016.02.29)**

行业	家数	权重 (%)	贡献点数
金融地产	20	25.33	-44.14
可选消费	18	20.97	-13.45
信息技术	21	20.85	-25.83
工业	13	9.94	-19.05
主要消费	8	7.81	-7.09
原材料	10	6.78	7.51
医药卫生	4	3.64	-6.98
电信业务	3	3.47	-15.75
公用事业	2	0.86	0.25
能源	1	0.36	-0.61
总计	100	100	-125.14

**市场分布 (2016.02.29)**

市场	家数	权重 (%)	贡献点数
深市主板	58	61.40	-50.87
中小板	28	25.41	-39.91
创业板	14	13.19	-34.35
沪市	/	/	/
总计	100	100	-125.14

**样本股自由流通市值分布 (2016.02.29)**

最大	最小	均值	中值
1305.69	66.13	193.48	144.53

**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
3239.14	-2.33%	-77.43	3662.89	41909.66	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
285460.47	108729.97	72.24%	15.77	15.48	1.98%

**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	29.01	2863.27	2.63	601328	交通银行	5.17	1246.08	1.15
600016	民生银行	8.45	2368.38	2.18	600000	浦发银行	18.45	1232.74	1.13
601166	兴业银行	14.18	1630.81	1.50	601288	农业银行	2.99	1059.45	0.97
600036	招商银行	14.56	1461.26	1.34	600030	中信证券	14.28	1051.54	0.97
000002	万科A	24.43	1305.69	1.20	600837	海通证券	12.40	1003.42	0.92

**涨幅前 5 名样本股**

代码	简称	收盘	涨幅%	贡献点数
600547	山东黄金	25.26	51.35	1.77
000807	云铝股份	7.8	36.84	0.49
002001	新和成	19	35.62	0.68
002299	圣农发展	24.38	33.66	0.70
002714	牧原股份	54.06	30.11	0.53

**跌幅前 5 名样本股**

代码	简称	收盘	涨幅%	贡献点数
000973	佛塑科技	8.01	-38.38	-1.06
000901	航天科技	34.3	-35.14	-1.16
002269	美邦服饰	3.98	-34.43	-0.63
002465	海格通信	11.2	-32.89	-2.34
601018	宁波港	5.69	-30.27	-2.31

**行业分布 (2016.02.29)**

行业	家数	权重 (%)	贡献点数
金融地产	111	29.32	-21.72
工业	231	17.60	-24.12
信息技术	148	11.75	-16.02
可选消费	127	11.06	-10.58
原材料	138	9.45	6.20
医药卫生	85	6.50	-5.04
主要消费	57	5.65	-0.97
公用事业	39	3.34	-1.82
能源	32	2.67	1.47
电信业务	32	2.66	-4.82
总计	1000	100	-77.43

**市场分布 (2016.02.29)**

市场	家数	权重 (%)	贡献点数
深市主板	184	17.92	-14.95
中小板	219	14.63	-15.82
创业板	94	6.58	-12.94
沪市	503	60.88	-33.72
总计	1000	100	-77.43

**样本股自由流通市值分布 (2016.02.29)**

最大	最小	均值	中值
2863.27	14.35	108.73	62.47

## 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)