

国证价值指数

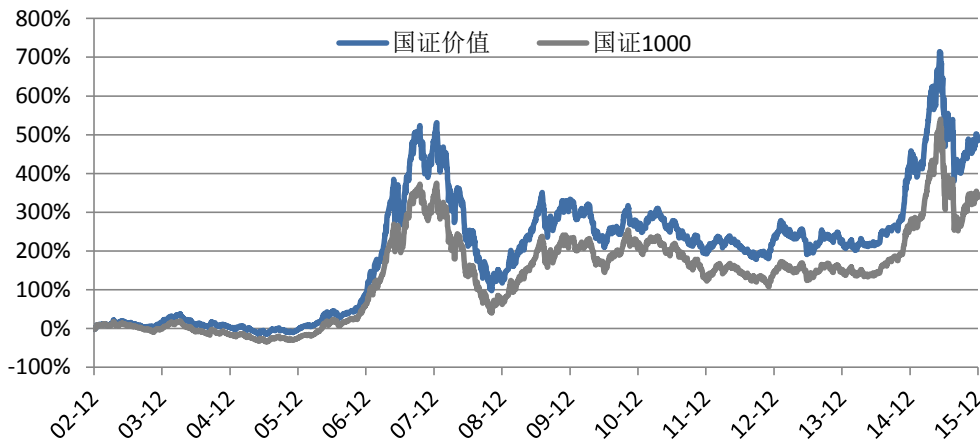
CNI VALUE INDEX

国证价值由国证1000指数样本股中价值风格突出的股票编制而成，为可交易的指数产品和金融衍生工具提供标的物。

指数信息

指数简称	指数代码	样本股数量	发布日	基日	基点	调样频率
国证价值	399371	332	2010.01.04	2002.12.31	1000	半年

指数走势 (2002.12.31-2015.12.31)



指数阶段收益 (-2015.12.31)

指数	累计收益				年化收益率		
	近一个月	近三个月	近一年	今年以来	基日以来	近三年	近五年
国证价值	5.33%	16.10%	8.42%	8.42%	14.56%	19.94%	9.97%
国证1000	4.22%	20.08%	18.41%	18.41%	12.05%	20.92%	6.80%

风险收益特征 (-2015.12.31)

指数	年化波动率 (日收益)			夏普比率 (日收益)		
	基日以来	近三年	近五年	基日以来	近三年	近五年
国证价值	28.81%	28.33%	25.16%	3.76%	4.86%	3.00%
国证1000	28.59%	28.16%	25.60%	3.27%	5.07%	2.23%

国证系列|风格指数

十大权重股样本 (2016.1.4)

证券代码	证券名称	行业	权重%
601318	中国平安	金融地产	6.12
600016	民生银行	金融地产	4.61
601166	兴业银行	金融地产	3.44
600036	招商银行	金融地产	3.16
601328	交通银行	金融地产	2.66
000002	万科A	金融地产	2.38
600000	浦发银行	金融地产	2.16
601288	农业银行	金融地产	2.01
601398	工商银行	金融地产	1.75
601169	北京银行	金融地产	1.67
总计			29.96

行业分布 (2016.1.4)

行业	家数	权重%
金融地产	48	43.88
工业	76	15.27
可选消费	53	12.72
原材料	62	9.54
公用事业	28	6.27
主要消费	22	4.78
能源	19	3.51
医药卫生	14	1.82
电信业务	3	1.33
信息技术	7	0.87
总计	332	100.00

自由流通市值 (亿元, 2016.1.4)

指数	最大样本股	最小样本股	样本股均值	样本股中位数
54950.71	3360.72	27.58	165.51	77.74

免责声明

本资料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。上述资料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。我公司保留本资料所有版权, 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。