

巨潮小盘价值

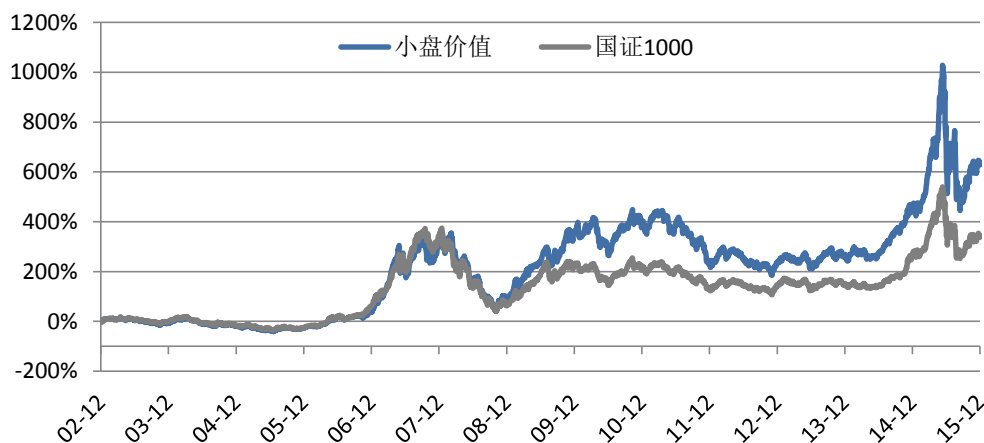
CNI SMALL CAP.VALUE

为反映A股市场中各规模板块中成长风格和价值风格突出的股票的价格变动情况，编制风格系列指数，为市场提供业绩比较基准和可投资的指数标的。

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
小盘价值	399377	166	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
小盘价值	4.20%	25.99%	30.59%	30.59%	16.52%	29.04%	8.15%
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
小盘价值	32.54%	33.08%	29.94%	3.90%	5.89%	2.44%
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%
600487	亨通光电	电信业务	1.29
002308	威创股份	信息技术	1.16
000979	中弘股份	金融地产	1.13
600884	杉杉股份	信息技术	1.02
000973	佛塑科技	原材料	0.97
002489	浙江永强	可选消费	0.96
000006	深振业 A	金融地产	0.95
600325	华发股份	金融地产	0.93
600694	大商股份	可选消费	0.93
002508	老板电器	可选消费	0.92
总计			10.26

行业分布 (2016.1.4)

行业	家数	权重%
工业	39	22.59
可选消费	30	19.15
原材料	34	18.95
金融地产	16	10.72
医药卫生	10	6.84
公用事业	10	5.73
主要消费	10	5.72
信息技术	7	4.99
能源	9	4.02
电信业务	1	1.29
总计	166	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
9634.41	123.85	27.58	58.04	54.64

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。