

国证食品指数

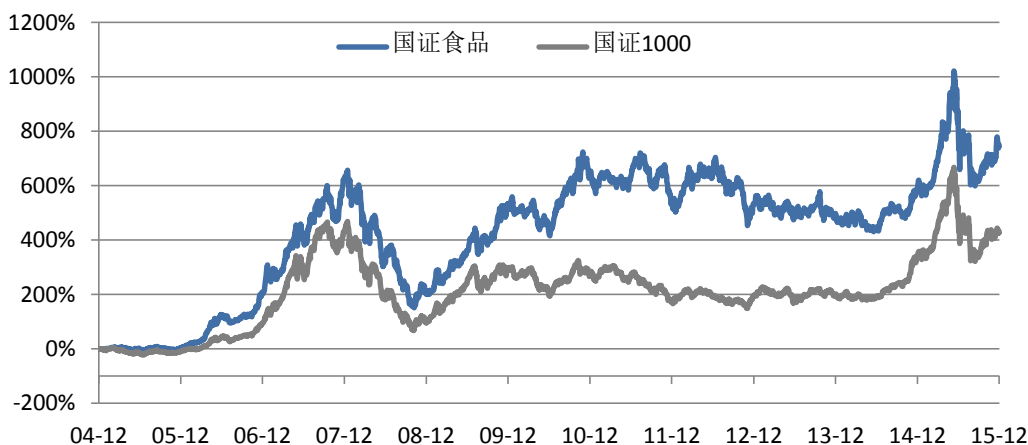
CNI FOOD & BEVERAGE

国证食品饮料行业指数参照巨潮上市公司行业分类标准，选取A股市场上归属于食品饮料行业的规模和流动性突出的50只股票作为样本股，反映了食品饮料行业上市公司的整体收益表现，向市场提供细分行业的指数化投资标的。

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
国证食品	399396	50	2012. 10. 29	2004. 12. 31	1000	半年

指数走势 (2004. 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
国证食品	8.34%	18.27%	23.20%	23.20%	21.43%	9.98%	2.50%
国证1000	4.22%	20.08%	18.41%	18.41%	16.29%	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
国证食品	29.88%	27.14%	25.41%	4.96%	2.91%	1.18%
国证1000	29.92%	28.16%	25.60%	4.02%	5.07%	2.23%

国证系列|主题指数

十大权重股样本（2016.1.4）

证券代码	证券名称	行业	权重%
600519	贵州茅台	主要消费	15.35
600887	伊利股份	主要消费	14.56
000858	五粮液	主要消费	8.74
002304	洋河股份	主要消费	6.53
000895	双汇发展	主要消费	3.48
600873	梅花生物	主要消费	3.46
000568	泸州老窖	主要消费	3.26
600737	中粮屯河	主要消费	2.64
300146	汤臣倍健	主要消费	1.93
603288	海天味业	主要消费	1.82
总计			61.77

行业分布（2016.1.4）

行业	家数	权重%
主要消费	50	100.00
原材料	/	/
医药卫生	/	/
金融地产	/	/
工业	/	/
信息技术	/	/
可选消费	/	/
电信业务	/	/
能源	/	/
公用事业	/	/
总计	50	100.00

自由流通市值（权重调整后，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
4899.51	752.18	19.12	97.99	47.91

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。