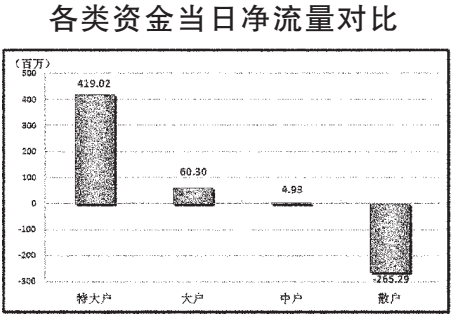




■ 资金策市 | Money Flow |



市场资金动态

行业	涨幅(%)	资金净流量(亿元)	特大户(亿元)	大户(亿元)
沪深300	0.45	-1.19	0.49	0.30
上证180	0.31	-1.83	0.80	-0.28
深证成指	0.84	-0.69	-0.39	0.25
中小板指	1.20	1.79	-0.03	0.74
大盘股	-	-2.12	0.40	-0.04
中盘股	-	1.15	0.17	0.57
小盘股	-	3.16	3.62	0.07

资金净流入(出)行业前五

行业	资金净流量(亿元)	主力资金(亿元)	散户(亿元)	回报(%)
房地产	2.35	0.67	1.27	1.34
交运设备	1.50	0.61	0.70	0.83
食品饮料	1.47	0.82	0.36	1.67
证券信托	1.43	-0.11	1.07	0.88
保险	1.12	0.63	0.28	1.08
行业	资金净流量(亿元)	主力资金(亿元)	散户(亿元)	回报(%)
银行	-2.83	-0.48	-1.70	-0.79
有色金属	-2.46	-0.46	-1.65	0.10
农林牧渔	-1.00	0.08	-0.89	0.12
交通运输	-0.89	-0.06	-0.68	0.08
公用事业	-0.55	-0.09	-0.38	-0.29

每日个股资金净流入(出)前十

净流入排名				
代码	简称	资金净流量(亿元)	主力资金(亿元)	日涨跌(%)
600113	浙江东日	1.18	0.47	9.99
600519	贵州茅台	1.14	0.78	2.80
600303	曙光股份	1.04	0.33	9.90
002407	多 频 多	1.03	0.95	3.66
002459	天业通联	0.72	0.91	-3.11
600383	金地集团	0.68	0.29	2.72
600851	海欣股份	0.67	0.18	10.05
601628	中国人寿	0.62	0.35	1.59
601901	方正证券	0.61	0.21	2.34
002411	九 九 久	0.53	0.49	3.92
净流出排名				
代码	简称	资金净流量(亿元)	主力资金(亿元)	日涨跌(%)
600030	中信证券	-2.29	-1.36	-0.24
600036	招商银行	-0.87	-0.18	-1.03
600565	通商银行	-0.67	-0.40	-5.92
600016	民生银行	-0.65	-0.36	-0.34
600260	凯乐科技	-0.63	-0.23	-0.14
000157	中联重科	-0.61	-0.21	0.22
600362	江西铜业	-0.56	-0.26	-1.23
002596	海南瑞泽	-0.55	-0.14	-7.01
600503	华联家族	-0.54	-0.34	-3.60
000858	五 粮 液	-0.53	-0.30	0.65

个股连续流入(出)天数排名

代码	简称	连续流入天数	累计净流量(亿元)	累计涨跌(%)
600960	渤海活塞	32	8.59	11.47
002407	多 频 多	25	14.18	9.78
002411	九 九 久	14	4.54	7.97
002459	天业通联	8	5.61	9.77
002508	老板电器	8	2.57	0.96
代码	简称	连续流出天数	累计净流量(亿元)	累计涨跌(%)
000100	TCL 集团	25	-3.29	-9.95
002264	新华都	23	-0.93	-19.68
600087	*ST 长油	19	-0.77	-17.26
000981	银亿股份	19	-0.16	-7.53
002005	德豪润达	17	-1.12	-23.13

代码	简称	连续流入天数	累计净流量(亿元)	累计涨跌(%)
600960	渤海活塞	32	8.59	11.47
002407	多 频 多	25	14.18	9.78
002411	九 九 久	14	4.54	7.97
002459	天业通联	8	5.61	9.77
002508	老板电器	8	2.57	0.96
代码	简称	连续流出天数	累计净流量(亿元)	累计涨跌(%)
000100	TCL 集团	25	-3.29	-9.95
002264	新华都	23	-0.93	-19.68
600087	*ST 长油	19	-0.77	-17.26
000981	银亿股份	19	-0.16	-7.53
002005	德豪润达	17	-1.12	-23.13

据 STCN 资金流向快报 (<http://data.stcn.com/statisticalData.shtml>) 数据显示, 7月24日, 沪深两市共流入资金2.19亿元, 资金结束昨日的流出状态, 转而流入。其中, 沪市净流入0.15亿元, 深市净流入2.04亿元。主力资金合计流入4.79亿元。

指数方面, 上证180指数成份股资金流出1.83亿元, 沪深300指数成份股资金流出6872.17万元, 沪深证成指成份股资金流出1.19亿元。以股本规模计, 流通股中大盘股资金流出2.12亿元, 中盘股资金流入1.15亿元, 小盘股资金流入3.16亿元。

行业方面, 按照衍生申万一级行业分类计, 有13个行业资金净流入, 12个行业资金净流出。其中, 房地产流入资金2.35亿, 成为资金最关注的行业; 银行流出资金2.83亿, 有较明显资金出逃现象。

有色金属业已持续3个交易日净流出资金, 共流出资金17.93亿元, 为行业连续流出天数榜第一。

渤海活塞已持续32个交易日净流入资金, 累计流入资金8.59亿, 居个股连续流入天数榜首位。TCL集团已持续25个交易日净流出资金, 累计流出资金3.29亿, 为个股连续流出天数榜第一。

股指期货方面, IF1208 合约收报2382.40点, 微涨0.11%; 成交37.27万手, 持仓量减409手, 收报5.97万手; 资金净流入16.61亿。

(本栏目数据来源: 名策数据)

9只股票上市 10 年才获基金青睐成为重仓

2012 年基金二季报数据显示, 842 只个股进入基金前十大, 其中, 9 只个股自 1998 年公布基金投资组合数据以来, 此次二季报首次入选基金重仓股名单, 尤其值得关注。

从二季度基金调仓情况来看, 基金新进持有 216 只个股, 增持 324 只个股, 减持 287 只个股, 而一季度被重仓、二季度遭抛弃的个股共有 203 只。股票型基金二季度平均仓位达 84.27%, 自去三季度基金重仓股名单, 尤其值得关注。

在新进与增持的 540 只个股中, 重仓股数最大的为保利地产, 6 月末被 164 只基金交叉持有, 比一季末增加 46 只, 二季度基金共计增持 44001.33 万股, 增持比例达 29.03%。同属于房地产板块的金地集团与万科 A 也入选重仓股前十大。金地集团二季度被 78 只基金重仓, 与一季度相比增持 28973.5 万股, 增持比例为 42.97%。万科 A 二季度被 200 只基金持有, 环比增持 21591.56 万股, 增持比例达 9.88%。此外, 券商股海通证券与中信证券, 保险股中国平安均入围前十大重仓股行列。

尽管基金调仓不断, 但总有些业绩良好或具备成长性的个股调不出基金的重仓股名单。据统计, 自 2007 年基金二季报以来, 81 只个股持续 5 年入围前十大, 成为基金必配品种。5 年来基金必配的 81 只个股中, 38 只二季度基金持股数过亿, 虽然民生银行遭众基金减持, 但持股数仍达到 246473.39 万股, 排名第一位, 此外, 万科 A、招商银行等 6 只个股基金持股数超过十亿。与之相比, 武钢股份虽然被基金连续 5 年重仓, 但

在二季度基金前十大减仓股阵营中, 6 只属于银行股, 招商银行、浦发银行、民生银行排名前三, 分别减持 60827.9 万股、50722.85 万股和 44948.49 万股。

上市超过 10 年的 1121 只个股中, 2012 年二季度首次入围基金前十大的仅有 9 只, 与之相比, 233 只个股始终未被基金重仓。

这 9 只新进个股中, 中弘股份被工银瑞信核心价值和工银瑞信主题策略 2 只基金共同持有, 累计持股数 4511.59 万股, 占流通 A 股的比例达 15.24%, 排名居首位。该公司归属于

中航动控自 1997 年上市以来, 本次二季报首度入围基金重仓股名单。国泰基金管理公司旗下的国泰双利债券 A 和民生加银基金管理公司旗下的民生加银信用双利债券 A 同时将该股列为前十大重仓股, 合计持有 714.51 万股。此外, 重庆实业、西南药业等个股虽然基金持股数不足百万, 但同样入围前十大重仓股名单。

(李千)

上市逾 10 年且 2012 年二季度首度进入基金前十大个股

代码	简称	2012 年二季度基金持股情况			2002 年到 2011 年		2012 年一季度		2012 年		2012 年二季度	
		只数	持股数(万股)	占流通 A 股比例(%)	盈利年度	亏损年度	净利润(万元)	上半年业绩预告	业绩预告	业绩预告	涨跌幅(%)	
000703	恒逸石化	1	27.03	0.10	6	4	44 865.66	预降	-20.47			
000711	天伦置业	1	12.50	0.08	9	1	141.11	预降	21.95			
000736	重庆实业	1	23.74	0.19	8	2	8 576.43	预增	79.22			
000738	中航动控	2	714.51	3.89	8	2	2 161.24	-	1.42			
000750	国海证券	1	149.53	0.41	5	5	6 511.00	-	84.60			
000885	同力水泥	1	36.66	0.33	7	3	2 598.94	-	27.81			
000979	中弘股份	2	4 511.59	15.24	5	5	13 096.44	预增	18.21			
600200	江苏吴中	1	44.26	0.08	9	1	341.69	预增	0.77			
600666	西南药业	1	10.00	0.03	10	-	1 989.36	-	-0.14			

基金爱慕 81 只股票 5 年长相守

尽管基金调仓不断, 但总有些业绩良好或具备成长性的个股调不出基金的重仓股名单。据统计, 自 2007 年基金二季报以来, 81 只个股持续 5 年入围前十大, 成为基金必配品种。5 年来基金必配的 81 只个股中, 38 只二季度基金持股数过亿, 虽然民生银行遭众基金减持, 但持股数仍达到 246473.39 万股, 排名第一位, 此外, 万科 A、招商银行等 6 只个股基金持股数超过十亿。与之相比, 武钢股份虽然被基金连续 5 年重仓, 但

二季度持股数仅为 230.05 万股, 平煤股份等 4 只个股持股数也不足千万。

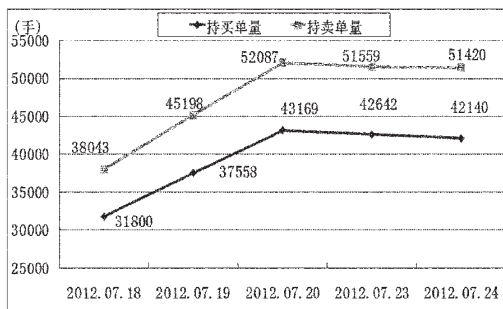
基金必配股行业分布显示, 金融保险业入围的股票最多, 共 11 只; 采掘和机械设备行业均有 10 只个股被基金连续 5 年重仓持有。

(李千)

2007 年二季度以来连续 5 年进入基金前十大个股

代码	简称	2012 年二季度基金持股情况			代码	简称	2012 年二季度基金持股情况			代码	简称	2012 年二季度基金持股情况		
		只数	持股数(万股)	占流通 A 股比例(%)			只数	持股数(万股)	占流通 A 股比例(%)			只数	持股数(万股)	占流通 A 股比例(%)
600016	民生银行	122	246 473.39	10.91	600153	建发股份	15	17 539.21	7.84	600660	福耀玻璃	6	4 940.91	2.52
000002	万科 A	200	240 155.42	24.86	600855	海螺水泥	19	16 024.26	4.01	000061	农产品	2	4 820.14	3.52
600036	招商银行	128	155 971.66	8.83	600276	恒瑞医药	45	15 468.41	12.55	600859	王府井	16	4 802.70	11.50
600000	浦发银行	95	127 847.85	8.57	600570	恒生电子	21	15 166.11	24.31	600085	同仁堂	12	4 394.63	3.38
600048	保利地产	164	124 251.08	17.72	600015	华夏银行	22	15 124.72	3.03	600858	银座股份	6	4 106.69	8.66
601328	交通银行	63	120 593.31	3.69	600519	贵州茅台	270	14 759.44	14.22	600900	长江电力	9	4 096.07	0.56
601166	兴业银行	127	104 558.41	9.69	601699	潞安环能	17	13 309.16	5.78	600600	青岛啤酒	18	4 075.13	5.86
600383	金地集团	78	96 405.17	21.56	601628	中国人寿	34	13 246.88	0.64	600325	华发股份	6	3 813.34	4.67
000531	格力电器	131	81 275.57	27.37	600309	烟台万华	11	12 705.03	5.88	600729	燕京啤酒	6	3 540.29	1.60
600030	中信证券	162	80 623.90	8.21	000423	东阿阿胶	54	12 235.54	18.72	000338	潍柴动力	11	3 093.82	4.48
601318	中国平安	299	74 026.37	15.47	600583	海油工程	7	10 027.25	2.58	600489	中金黄金	12	2 914.78	1.58
002024	苏宁电器	54	64 249.35	11.82	600271	航天信息	13	9 779.72	10.59	600970	中材国际	4	2 888.99	2.64
601398	工商银行	25	58 634.14	0.22	600315	上海家化	42	9 664.12	22.85	600089	特变电工	6	2 444.46	0.93
000157	中联重科	71	55 412.29	8.83	000983	西山煤电	17	9 190.84	6.24	600062	华润双鹤	5	2 379.39	4.16
000069	华侨城 A	45	51 009.30	16.55	600688	S 上石化	2	8 832.67	12.27	600547	山东黄金	8	2 156.81	1.52
600518	康美药业	90	48 145.81	21.90	000895	双汇发展	54	8 790.87	14.51	002007	华兰生物	15	2 140.03	3.71
000858	五粮液	130	42 913.28	11.31	600019	宝钢股份	6	8 611.37	0.49	600880	博瑞传播	3	2 135.26	5.16
600050	中国联通	17	32 484.79	1.53	600694	大商股份	23	8 187.89	27.88	600348	阳光乳业	7	1 972.48	0.82
600031	三一重工	39	31 933.16	4.54	600123	兰花科创	9	6 361.19	5.57	000792	盐湖股份	1	1 943.74	3.37
000568	泸州老窖	107	31 040.26	22.26	600582	天地科技	10	5 998.52	5.93	600511	国药股份	6	1 572.72	5.66
601006	大秦铁路	25	28 354.51	1.91	600739	辽宁成大	14	5 797.81	4.25	600172	雅 克 尔	3	1 461.72	0.74
000527	美的电器	34	27 616.00	8.16	000800	一汽轿车	5	5 579.26	3.95	000848	承德露露	9	1 115.69	3.06
000001	深发展 A	48	27 507.41	8.86	600009	上海机场	11	5 556.27	5.08	600479	千金药业	2	949.99	3.12
600028	中国石化	24	25 909.90	0.37	000033	神火股份	2	5 370.78	3.20	600875	东方电气	5	948.91	0.61
600690	青岛海尔	27	25 598.56	9.53	000402	金融街	13	5 350.29	1.77	600655	豫园商城	1	520.00	0.36
000024	招商地产	72	24 850.05	36.32	002001	新和成	7	5 001.96	7.01	600666	平煤股份	2	293.03	0.13
000063	中兴通讯	47	21 053.08	7.54	000937	冀中能源	10	4 949.14	3.14	601005	武钢股份	1	230.05	0.02

前 20 名会员持买单量和卖单量合计



中金所结算会员成交持仓排名

成交量排名				持买单量排名				持卖单量排名			
名次	会员简称	成交量(手)	比上交易日增减	名次	会员简称	持买单量(手)	比上交易日增减	名次	会员简称	持卖单量(手)	比上交易日增减
1	华泰长城	58 100	10 742	1	国泰君安	4 889	- 409	1	中证期货	11 521	84
2	国泰君安	56 071	10 235	2	海通期货	3 532	395	2	国泰君安	8 026	-
3	兴证期货	47 563	7 234	3	华泰长城	3 445	- 175	3	海通期货	4 105	13
4	广发期货	47 382	5 193	4	银河期货	2 685	94	4	华泰长城	3 976	30
5	海通期货	42 227	- 3 126	5	南华期货	2 099	5	5	申银万国	3 450	5
6	光大期货	38 283	9 625	6	广发期货	2 579	- 58	6	光大期货	3 142	- 68
7	申银万国	29 095	5 461	7	光大期货	2 294	213	7	招商期货	2 309	- 1
8	鲁证期货	25 071	4 146	8	中证期货	2 242	- 303	8	中粮期货	2 168	5
9	南华期货	27 489	4 493	9	申银万国	2 127	40	9	金海期货	1 891	-
10	银河期货	22 245	5 288	10	信达期货	1 736	26	10	中银期货	1 532	2
11	中证期货	20 721	1 550	11	鲁证期货	1 692	- 33	11	鲁证期货	1 458	12
12	渤海期货	19 606	1 082	12	浙江永安	1 690	20	12	广发期货	1 407	1
13	上海东证	18 842	4 720	13	上海东证	1 539	- 134	13	宝城期货	1 112	22
14	中投证券	18 705	942	14	招商期货	1 492	- 19	14	南华期货	830	- 15
15	浙商期货	17 715	4 304	15	国信期货	1 442	- 129	15	兴业期货	814	8
16	招商期货	14 858	742	16	浙商期货	1 439	- 192	16	中投证券	814	- 9
17	国信期货	13 466	3 081	17	中投证券	1 238	153	17	国信期货	750	- 19
18	浙江永安	13 369	1 482	18	兴业期货	1 034	5	18	上海东证	745	- 26
19	金海期货	10 658	3 784	19	安信期货	936	77	19	海通期货	723	- 8
20	信达期货	10 130	244	20	东吴期货	920	15	20	中钢期货	647	-