

# 上交所股票型 ETF 涨跌停持仓分析报告

分析日期：2026 年 2 月 5 日

数据来源：东方财富

---

统计上交所所有股票型 *ETF* 收盘后持有涨停股和跌停股的金额

---

云砾网络

自动生成报告

## 目录

<b>1 报告摘要</b>	<b>2</b>
1.1 核心数据	2
<b>2 涨停股持仓分析</b>	<b>2</b>
2.1 涨停股持仓 ETF 排名（按数量）	2
2.2 涨停股明细	3
<b>3 跌停股持仓分析</b>	<b>3</b>
3.1 跌停股持仓 ETF 排名（按数量）	3
3.2 跌停股明细	4
<b>4 重点 ETF 分析</b>	<b>4</b>
4.1 宽基指数 ETF	4
4.2 行业主题 ETF	4
<b>5 投资风险提示</b>	<b>5</b>
5.1 涨停股持仓风险	5
5.2 跌停股持仓风险	5
5.3 投资建议	5
<b>6 附录：数据说明</b>	<b>5</b>
6.1 数据来源	5
6.2 统计口径	6
6.3 免责声明	6

## 1 报告摘要

本报告统计了上交所股票型 ETF 在 2026 年 2 月 5 日收盘后持有涨停股和跌停股的情况。通过分析 84 只 ETF 的持仓数据，筛选出持有涨停股和跌停股的 ETF，并按持仓数量和金额进行排序。

### 1.1 核心数据

统计项目	数值
分析 ETF 总数	84 只
当日涨停股票数量	44 只
当日跌停股票数量	15 只
持有涨停股的 ETF 数量	20 只
持有跌停股的 ETF 数量	10 只
涨停股总持仓金额	24.89 万元
跌停股总持仓金额	17.57 万元

表 1: 分析数据汇总

## 2 涨停股持仓分析

### 2.1 涨停股持仓 ETF 排名（按数量）

以下 ETF 持有涨停股数量最多，投资者需关注相关 ETF 的流动性风险。

排名	ETF 名称	代码	涨停股数量	金额 (万元)
1	1000ETF	512100	10	3.82
2	500ETF	510500	7	7.53
3	2000ETF	560010	4	1.28
4	光伏 ETF	515790	3	4.13
5	证券 ETF	512880	3	2.46
6	煤炭 ETF	515220	3	1.84
7	软件 ETF	512660	3	1.54
8	芯片龙头	512200	3	0.55
9	稀土 ETF	515210	2	0.34
10	军工 ETF	512670	1	0.34

表 2: 涨停股持仓 ETF 排名（前 10 名）

## 2.2 涨停股明细

本日被 ETF 持有的主要涨停股票包括：

股票代码	股票名称	被持有 ETF
002291	遥望科技	1000ETF
601015	陕西黑猫	1000ETF、煤炭 ETF
603103	横店影视	1000ETF
002506	协鑫集成	1000ETF、光伏 ETF、AIETF、锂电 ETF、新能源车、养老 ETF
601187	厦门银行	1000ETF、银行 ETF
002985	北摩高科	1000ETF、军工 ETF、软件 ETF、影视 ETF
000636	风华高科	500ETF
002945	华林证券	500ETF、证券 ETF、基建 ETF、国企改革
603826	坤彩科技	500ETF、有色 ETF
600683	京投发展	芯片龙头
600382	广东明珠	稀土 ETF
601599	浙文影业	国企 ETF

表 3: 涨停股被持有情况明细

## 3 跌停股持仓分析

### 3.1 跌停股持仓 ETF 排名（按数量）

以下 ETF 持有跌停股数量最多，可能面临净值下跌压力。

排名	ETF 名称	代码	跌停股数量	金额 (万元)
1	光伏 ETF	515790	7	4.93
2	500ETF	510500	4	7.42
3	1000ETF	512100	4	2.23
4	2000ETF	560010	3	0.85
5	养老 ETF	512580	3	0.18
6	稀土 ETF	515210	2	1.06
7	AIETF	516160	1	0.52
8	有色 ETF	512400	1	0.36
9	锂电 ETF	516850	1	0.01
10	新能源车	516580	1	0.01

表 4: 跌停股持仓 ETF 排名（前 10 名）

### 3.2 跌停股明细

本日被 ETF 持有的主要跌停股票包括：

股票代码	股票名称	被持有 ETF
600481	双良节能	光伏 ETF
002518	科士达	光伏 ETF、1000ETF、2000ETF、养老 ETF
002865	钧达股份	光伏 ETF、养老 ETF
601212	白银有色	500ETF、有色 ETF
601615	明阳智能	500ETF、AIETF、锂电 ETF、新能源车、养老 ETF
002716	湖南白银	1000ETF、2000ETF
000923	河钢资源	1000ETF、2000ETF、稀土 ETF

表 5：跌停股被持有情况明细

## 4 重点 ETF 分析

### 4.1 宽基指数 ETF

宽基指数 ETF 由于持仓分散，涨跌停股影响相对有限。

ETF 名称	代码	涨停数	涨停金额	跌停数	跌停金额
50ETF	510050	0	0.00	0	0.00
300ETF	510300	0	0.00	0	0.00
500ETF	510500	7	7.53	4	7.42
1000ETF	512100	10	3.82	4	2.23
2000ETF	560010	4	1.28	3	0.85
科创 50	588000	0	0.00	0	0.00

表 6：宽基指数 ETF 涨跌停持仓（单位：万元）

**分析：**小市值指数 ETF（如 500ETF、1000ETF、2000ETF）由于成分股更容易出现涨跌停，相关持仓较多。而 50ETF、300ETF 等大盘蓝筹 ETF 则基本无涨跌停持仓。

### 4.2 行业主题 ETF

行业主题 ETF 持仓集中，受涨跌停影响更为明显。

**分析：**光伏 ETF 本日持有跌停股数量最多（7 只），需关注新能源板块的风险。证券 ETF 和煤炭 ETF 则表现较好，涨停股持仓较多。

ETF 名称	代码	涨停数	涨停金额	跌停数	跌停金额
光伏 ETF	515790	3	4.13	7	4.93
证券 ETF	512880	3	2.46	0	0.00
煤炭 ETF	515220	3	1.84	0	0.00
稀土 ETF	515210	2	0.34	2	1.06
AIETF	516160	1	0.31	1	0.52

表 7: 行业主题 ETF 涨跌停持仓 (单位: 万元)

## 5 投资风险提示

### 5.1 涨停股持仓风险

- **流动性风险:** 涨停股无法卖出, ETF 面临赎回压力时可能产生折价
- **估值风险:** 连续涨停可能导致 ETF 净值与实际价值偏离
- **溢价风险:** 部分 ETF 可能因持有涨停股而产生场内溢价

### 5.2 跌停股持仓风险

- **净值下跌风险:** 跌停股无法及时止损, 可能持续拖累 ETF 净值
- **折价风险:** 投资者预期继续下跌可能导致 ETF 场内折价
- **行业风险:** 跌停股集中的行业 ETF (如光伏 ETF) 需特别关注

### 5.3 投资建议

1. 关注持有涨停股较多的 ETF (如 1000ETF、500ETF), 警惕溢价风险
2. 规避持有跌停股较多的 ETF (如光伏 ETF), 防范进一步下跌
3. 宽基指数 ETF (50ETF、300ETF) 受涨跌停影响较小, 适合稳健投资
4. 行业 ETF 波动较大, 建议结合行业基本面综合判断

## 6 附录: 数据说明

### 6.1 数据来源

- **涨跌停股票数据:** 东方财富涨停板池/跌停板池
- **ETF 持仓数据:** 东方财富基金持仓明细
- **数据获取时间:** 2026 年 2 月 5 日收盘后

## 6.2 统计口径

- **涨停判断:** 涨跌幅达到或超过 10% (ST 股票 5%)
- **跌停判断:** 涨跌幅达到或超过-10% (ST 股票-5%)
- **ETF 范围:** 上交所上市的股票型 ETF (代码以 5 开头), 排除债券、货币、商品类 ETF
- **持仓金额:** 基于最新披露的持仓数据计算

## 6.3 免责声明

本报告仅供参考, 不构成任何投资建议。投资者应根据自身情况独立判断, 自行承担投资风险。数据可能存在延迟或误差, 请以官方披露为准。

---

报告生成时间: 2026 年 2 月 5 日

云砾网络 • 数据分析团队