

## 证券研究报告

## 金融工程与衍生品交易

## 融资融券日报

俞雪飞 金融工程高级分析师  
执业编号: S1500510120003  
联系电话: +86 10 83326567  
邮箱: yuxuefei@cindasc.com

**特别提示:** 本报告所列事件投资组合是由信达证券研发中心事件选股策略模型生成, 由于模型本身的局限性及事件的复杂性, 其组合收益率有着较大的不确定性, 不构成对任何人的投资建议。

信达证券股份有限公司  
CINDA SECURITIES CO.,LTD  
北京市西城区闹市口大街9号院1号楼  
邮编: 100031

## 融资融券每日投资参考

2016年10月31日

## 本期内容提要:

- 上一交易日, 沪深两市融资融券余额规模为 9098.53 亿元(-0.7%), 其中融资余额规模为 9058.21 亿元(-0.71%), 融券余额规模为 40.32 亿元(+1.78%)。从融资规模来看, 上一交易日沪深两市融资买入额为 422.13 亿元(+3.02%), 融资偿还额为 487.01 亿元(+24.15%)。
- 上一交易日, 市场指数中上证综指(-0.26%)表现最好, 中小板指(-0.88%)表现最弱; 从行业来看, 非银金融(+0.57%)、银行(+0.53%)、家用电器(-0.32%)、食品饮料(-0.45%)、采掘(-0.46%)等行业表现较好, 建筑装饰(-1.59%)、钢铁(-1.25%)、休闲服务(-1.18%)、商业贸易(-1.13%)、化工(-1.04%)等行业表现较弱。
- 两融标的股票中, 涨幅前五名为: 宁波建工(+10.07%)、皖新传媒(+10.02%)、开山股份(+5.07%)、南山铝业(+4.29%)和山西焦化(+4.13%); 跌幅前五名为: 国民技术(-6.3%)、生益科技(-5.73%)、齐翔腾达(-5.51%)、\*ST 沧大(-5.01%)和华胜天成(-4.94%); 五日量比前五名为: 鲁西化工(4.81)、开山股份(4.08)、湖北宜化(3.75)、科达洁能(3.7)和梅雁吉祥(3.63)。
- 上一交易日, 发生大宗交易的标的股票有美的集团、上海莱士、洋河股份等 11 只。
- 今日共有 41 只标的股票停牌, 其中今日开始停牌股票有云南城投等 1 只, 今日复牌股票有云南铜业等 1 只。
- 今日披露, 大股东增持标的股票有廊坊发展、上海家化等 2 只, 无大股东减持标的股票。
- 今日披露, 共有 5 只标的股票涉及增发事件, 其中新疆城建、云南铜业等 2 只发布董事会预案, 号百控股等 1 只股东大会通过, 没有股票涉及增发公告日, 沃尔核材、大富科技等 2 只为增发股份上市日。
- 今日披露, 没有标的股票涉及分红送转事件。
- 今日共有兴业矿业、天音控股、苏宁云商等 72 只标的股票发布业绩预告。
- 未来 7 个交易日共有盛运环保、大富科技、新大陆等 7 只标的股票涉及限售股解禁。

## 事件投资组合操作

- 今日建仓股票: 景兴纸业(业绩预增)、威创股份(业绩预增)。
- 今日拟平仓股票有福星股份、中粮屯河等 2 只。
- 上一交易日组合收益率为-1.32%, 至 2016 年 10 月 28 日组合累计收益率为 98.27%, 分别超越上证综指、沪深 300 及创业板指 44.69、41.52 及 27.7 个百分点。

## 目录

一、上一交易日市场回顾.....	4
1. 融资融券规模及主要市场指数表现.....	4
2. 行业融资规模及指数表现.....	5
3. 标的 ETF 基金表现.....	6
4. 标的股票表现及融资规模.....	6
5. 标的股票大宗交易.....	9
二、今日标的股票事件提示.....	10
1. 标的股票停复牌.....	10
2. 大股东增减持标的股票.....	11
3. 标的股票增发.....	11
4. 标的股票分红送转.....	11
5. 发布相关业绩报告的标的股票.....	12
6. 标的股票限售股解禁.....	13
三、事件投资组合操作.....	13
1. 组合历史收益.....	13
2. 今日组合操作.....	14
3. 昨日组合操作回顾.....	15
4. 组合成分股.....	15

## 图表目录

图表 1: 近三月每日融资融券余额规模 (亿元) .....	4
图表 2: 近三月每日融资买入额及偿还额 (亿元) .....	4
图表 3: 近期主要市场指数涨跌幅 (%) .....	5
图表 4: 上一交易日两融标的股票分行业融资余额占流通市值比例及增速 (%) .....	5
图表 5: 申万行业上一交易日涨跌幅 (%) .....	6
图表 6: 融资融券 ETF 上一交易日涨跌幅 (%) .....	6
图表 7: 上一交易日涨跌幅排名前 20 标的股票 .....	7
图表 8: 上一交易日五日量比排名前 20 标的股票 .....	7
图表 9: 上一交易日金额流入率排名前 20 标的股票 .....	8
图表 10: 上一交易日开盘、尾盘资金净流入排名前 20 标的股票.....	8
图表 11: 上一交易日融资余额占流通市值比例及增速排名前 10 标的股票.....	9
图表 12: 上一交易日发生大宗交易标的股票 .....	9
图表 13: 复牌及停牌标的股票.....	10
图表 14: 大股东持股比例变动标的股票.....	11
图表 15: 未来七个交易日标的股票增发.....	11
图表 16: 未来七个交易日发生分红送转事件标的股票.....	11
图表 17: 今日发布相关业绩报告的标的股票 .....	12
图表 18: 未来七个交易日标的股票限售解禁 .....	13
图表 19: 组合历史收益曲线.....	14
图表 20: 组合今年以来收益曲线.....	14
图表 21: 组合历史收益对比.....	14
图表 22: 今日拟建仓股票 .....	15

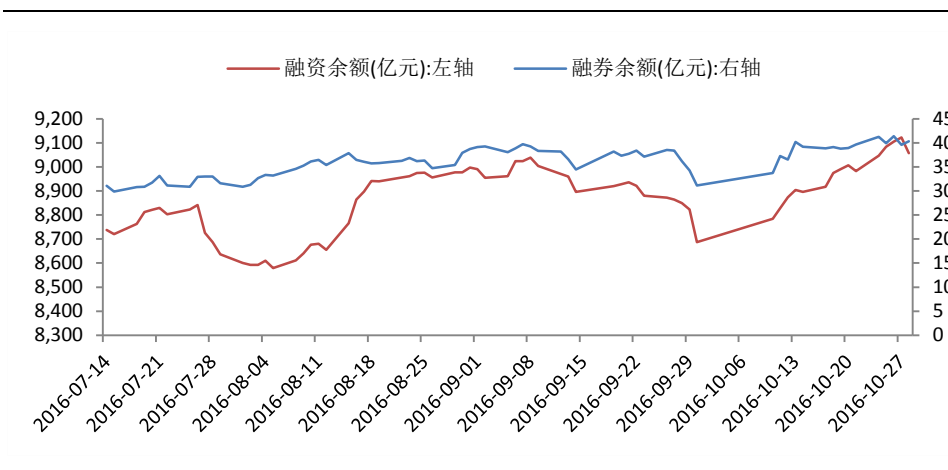
图表 23: 今日拟平仓股票.....	15
图表 24: 昨日建仓股票.....	15
图表 25: 昨日平仓股票.....	15
图表 26: 组合成分股.....	15

## 一、上一交易日市场回顾

### 1. 融资融券规模及主要市场指数表现

上一交易日，沪深两市融资融券余额规模为 9098.53 亿元(-0.7%)，其中融资余额规模为 9058.21 亿元(-0.71%)，融券余额规模为 40.32 亿元(+1.78%)。

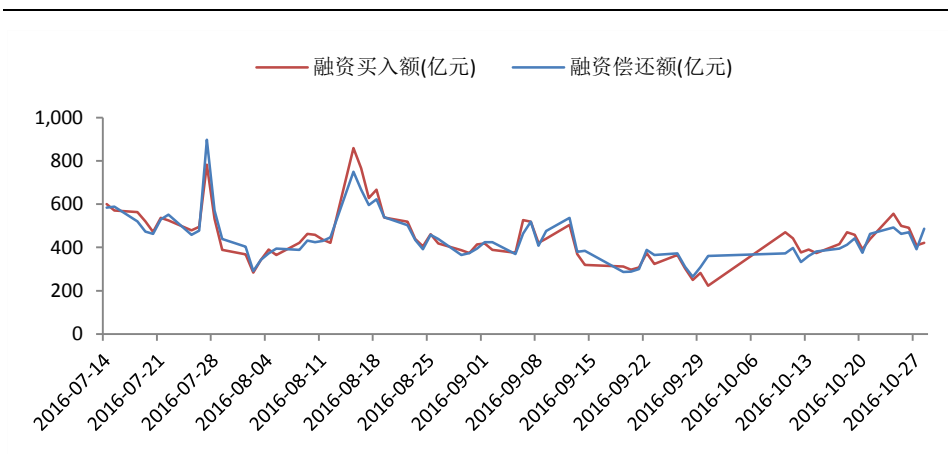
图表 1：近三月每日融资融券余额规模（亿元）



数据来源：wind、信达证券研发中心

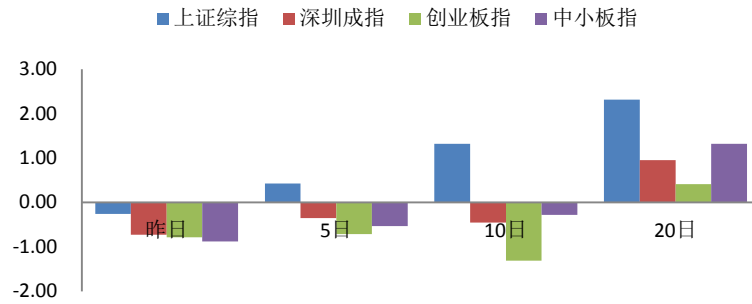
从融资规模来看，上一交易日沪深两市融资买入额为 422.13 亿元(+3.02%)，融资偿还额为 487.01 亿元(+24.15%)。

图表 2：近三月每日融资买入额及偿还额（亿元）



数据来源：wind、信达证券研发中心

上一交易日，市场指数中上证综指表现较好，下跌 0.26%，中小板指表现最弱，下跌 0.88%；从 5 日涨跌幅看，上证综指表现较好，上涨 0.43%，创业板指表现最弱，下跌 0.71%；从 10 日涨跌幅看，上证综指表现较好，上涨 1.32%，创业板指表现最弱，下跌 1.31%；从 20 日涨跌幅看，上证综指表现较好，上涨 2.32%，创业板指表现最弱，上涨 0.41%。

**图表 3：近期主要市场指数涨跌幅（%）**


数据来源：wind、信达证券研发中心

## 2. 行业融资规模及指数表现

上一交易日，从两融标的股票分行业融资余额占流通市值比例及增速来看，农林牧渔(+1.33%)、建筑材料(+1.29%)、建筑装饰(+0.91%)等行业增速居前，家用电器(-0.84%)、银行(-1.53%)、非银金融(-2.17%)等行业增速靠后。

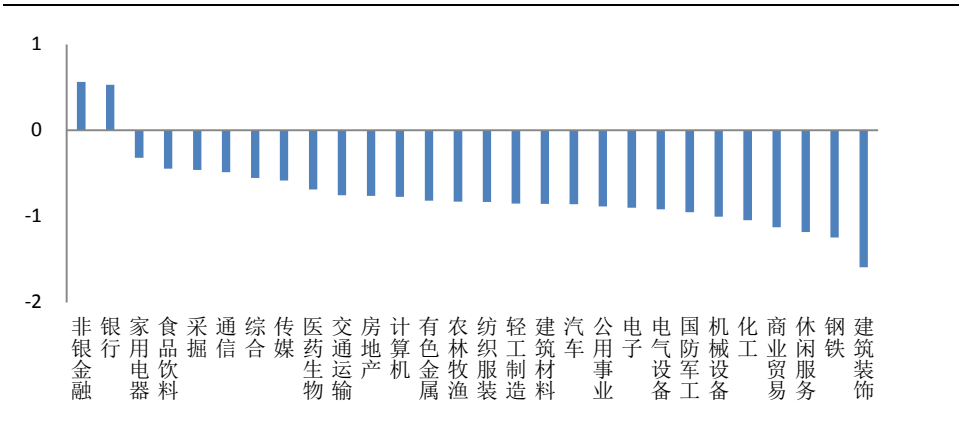
**图表 4：上一交易日两融标的股票分行业融资余额占流通市值比例及增速（%）**

序号	代码	行业	融资余额占流通市值比例(%)	占比增速(%)
1	801010.SI	农林牧渔	4.64	1.33
2	801710.SI	建筑材料	4.86	1.29
3	801720.SI	建筑装饰	2.51	0.91
4	801230.SI	综合	9.90	0.75
5	801200.SI	商业贸易	5.94	0.67
6	801210.SI	休闲服务	2.66	0.55
7	801180.SI	房地产	4.34	0.38
8	801080.SI	电子	6.64	0.35
9	801890.SI	机械设备	4.59	0.30
10	801130.SI	纺织服装	6.39	0.24
11	801730.SI	电气设备	4.99	0.21
12	801050.SI	有色金属	5.57	0.07
13	801140.SI	轻工制造	7.77	0.00
14	801750.SI	计算机	6.91	0.00
15	801030.SI	化工	3.63	-0.06
16	801040.SI	钢铁	2.55	-0.10
17	801880.SI	汽车	2.89	-0.13
18	801150.SI	医药生物	3.65	-0.17
19	801020.SI	采掘	0.91	-0.21
20	801170.SI	交通运输	2.68	-0.21
21	801770.SI	通信	5.77	-0.23
22	801120.SI	食品饮料	1.73	-0.24
23	801740.SI	国防军工	4.18	-0.29
24	801160.SI	公用事业	3.10	-0.31
25	801760.SI	传媒	6.65	-0.55
26	801110.SI	家用电器	2.69	-0.84
27	801780.SI	银行	0.73	-1.53
28	801790.SI	非银金融	3.23	-2.17

数据来源: wind、信达证券研发中心

上一交易日,从行业板块涨跌幅来看,非银金融(+0.57%)、银行(+0.53%)、家用电器(-0.32%)、食品饮料(-0.45%)、采掘(-0.46%)等行业表现较好,建筑装饰(-1.59%)、钢铁(-1.25%)、休闲服务(-1.18%)、商业贸易(-1.13%)、化工(-1.04%)等行业表现较弱。

图表 5: 申万行业上一交易日涨跌幅 (%)

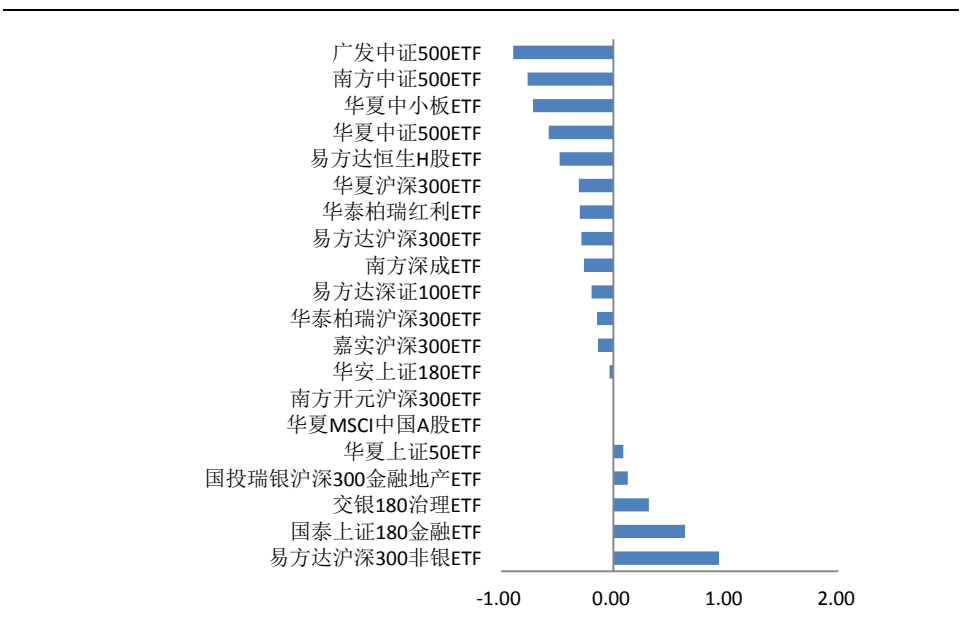


数据来源: wind、信达证券研发中心

### 3. 标的 ETF 基金表现

上一交易日,两融标的ETF基金中涨幅前三名为:易方达沪深300非银ETF(+0.94%)、国泰上证180金融ETF(+0.64%)及交银180治理ETF(+0.32%);跌幅前三名为:广发中证500ETF(-0.89%)、南方中证500ETF(-0.76%)及华夏中小板ETF(-0.72%)。

图表 6: 融资融券ETF上一交易日涨跌幅 (%)



数据来源: wind、信达证券研发中心

### 4. 标的股票表现及融资规模

上一交易日,两融标的股票中,涨幅前五名为:宁波建工(+10.07%)、皖新传媒(+10.02%)、开山股份(+5.07%)、南山铝业(+4.29%)和山西焦化(+4.13%);跌幅前五名为:国民技术(-6.3%)、生益科技(-5.73%)、齐翔腾达(-5.51%)、\*ST 沧大(-5.01%)和华胜天成(-4.94%)。

**图表 7：上一交易日涨跌幅排名前 20 标的股票**

排名	涨幅前 20				跌幅前 20			
	股票代码	股票简称	股价涨幅 (%)	五日量比	股票代码	股票简称	股价跌幅 (%)	五日量比
1	601789.SH	宁波建工	10.07	1.97	300077.SZ	国民技术	-6.30	1.01
2	601801.SH	皖新传媒	10.02	1.96	600183.SH	生益科技	-5.73	0.86
3	300257.SZ	开山股份	5.07	4.08	002408.SZ	齐翔腾达	-5.51	1.81
4	600219.SH	南山铝业	4.29	2.25	600230.SH	*ST 沧大	-5.01	0.56
5	600740.SH	山西焦化	4.13	0.98	600410.SH	华胜天成	-4.94	1.37
6	600113.SH	浙江东日	4.07	1.80	002016.SZ	世荣兆业	-4.93	1.35
7	600149.SH	廊坊发展	3.73	1.54	000731.SZ	四川美丰	-4.77	0.69
8	000830.SZ	鲁西化工	3.18	4.81	002001.SZ	新和成	-4.59	2.32
9	002393.SZ	力生制药	3.16	3.23	600654.SH	中安消	-4.23	1.22
10	002048.SZ	宁波华翔	3.14	1.93	601038.SH	一拖股份	-4.22	0.70
11	000400.SZ	许继电气	3.11	2.48	601002.SH	晋亿实业	-4.19	0.99
12	002065.SZ	东华软件	2.96	3.14	002251.SZ	步步高	-4.10	1.20
13	002106.SZ	莱宝高科	2.93	1.64	000960.SZ	锡业股份	-4.10	0.96
14	600293.SH	三峡新材	2.71	1.85	601390.SH	中国中铁	-4.04	0.63
15	600566.SH	济川药业	2.69	0.92	600783.SH	鲁信创投	-4.00	1.25
16	000422.SZ	湖北宜化	2.66	3.75	600459.SH	贵研铂业	-3.97	0.88
17	600478.SH	科力远	2.62	2.96	002476.SZ	宝莫股份	-3.96	0.51
18	601688.SH	华泰证券	2.51	2.20	600609.SH	金杯汽车	-3.96	1.33
19	002118.SZ	紫鑫药业	2.40	2.07	601118.SH	海南橡胶	-3.95	1.22
20	300026.SZ	红日药业	2.38	1.78	601800.SH	中国交建	-3.88	0.68

数据来源：wind、信达证券研发中心

上一交易日，标的股票五日量比前五名为：鲁西化工（4.81）、开山股份（4.08）、湖北宜化（3.75）、科达洁能（3.7）和梅雁吉祥（3.63）。

**图表 8：上一交易日五日量比排名前 20 标的股票**

排名	五日量比前 20			
	股票代码	股票简称	股价涨幅 (%)	五日量比
1	000830.SZ	鲁西化工	3.18	4.81
2	300257.SZ	开山股份	5.07	4.08
3	000422.SZ	湖北宜化	2.66	3.75
4	600499.SH	科达洁能	0.45	3.70
5	600868.SH	梅雁吉祥	-1.21	3.63
6	002393.SZ	力生制药	3.16	3.23
7	600285.SH	羚锐制药	1.48	3.18
8	002065.SZ	东华软件	2.96	3.14
9	600478.SH	科力远	2.62	2.96
10	600109.SH	国金证券	0.99	2.79
11	600383.SH	金地集团	1.10	2.78
12	002285.SZ	世联行	-3.82	2.74
13	600316.SH	洪都航空	0.94	2.68
14	600470.SH	六国化工	0.51	2.54
15	002179.SZ	中航光电	-0.83	2.52
16	000400.SZ	许继电气	3.11	2.48

17	600066.SH	宇通客车	-2.17	2.45
18	600999.SH	招商证券	1.62	2.43
19	600422.SH	昆药集团	-3.01	2.39
20	002001.SZ	新和成	-4.59	2.32

数据来源: wind、信达证券研发中心

上一交易日,两融标的券中金额流入率最高的前五名是:中国银行(40.3%)、工商银行(38.13%)、香雪制药(33.64%)、许继电气(33.6%)、永辉超市(32.98%)。

图表 9: 上一交易日金额流入率排名前 20 标的股票

排名	股票代码	股票简称	股价涨幅 (%)	金额流入率 (%)	净流入资金 (百万)
1	601988.SH	中国银行	0.59	40.30	211.13
2	601398.SH	工商银行	0.45	38.13	136.75
3	300147.SZ	香雪制药	1.06	33.64	76.19
4	000400.SZ	许继电气	3.11	33.60	122.96
5	601933.SH	永辉超市	0.67	32.98	48.08
6	600551.SH	时代出版	1.35	29.81	42.42
7	002461.SZ	珠江啤酒	0.85	29.78	27.81
8	002065.SZ	东华软件	2.96	29.37	193.10
9	601939.SH	建设银行	0.57	28.93	106.24
10	600219.SH	南山铝业	4.29	28.55	228.31
11	000921.SZ	海信科龙	-0.36	28.45	24.94
12	002299.SZ	圣农发展	2.10	28.16	84.41
13	002041.SZ	登海种业	1.46	27.56	16.95
14	000607.SZ	华媒控股	0.00	26.57	54.99
15	000830.SZ	鲁西化工	3.18	25.99	104.75
16	300257.SZ	开山股份	5.07	25.92	56.68
17	600009.SH	上海机场	0.22	25.59	25.01
18	601998.SH	中信银行	1.16	24.18	38.90
19	002152.SZ	广电运通	0.26	24.09	17.33
20	600104.SH	上汽集团	1.04	23.68	59.01

数据来源: wind、信达证券研发中心

上一交易日,两融标的券中开盘金额流入率最高的前五名是:永辉超市(29.62%)、中国银行(26.17%)、长江证券(19.72%)、中信银行(19.24%)、天山股份(18.63%);尾盘金额流入率最高的前五名是:丹化科技(30.03%)、华媒控股(13.94%)、南山铝业(12.2%)、日海通讯(9.96%)、中海油服(9.45%)。

图表 10: 上一交易日开盘、尾盘资金净流入排名前 20 标的股票

排名	开盘净流入资金					尾盘净流入资金				
	股票代码	股票简称	股价涨幅 (%)	金额流入率 (%)	净流入资金(百万)	股票代码	股票简称	股价涨幅 (%)	金额流入率 (%)	净流入资金(百万)
1	601933.SH	永辉超市	0.67	29.62	43.19	600844.SH	丹化科技	1.62	30.03	58.61
2	601988.SH	中国银行	0.59	26.17	137.29	000607.SZ	华媒控股	0.00	13.94	33.44
3	000783.SZ	长江证券	0.37	19.72	146.16	600219.SH	南山铝业	4.29	12.20	97.54
4	601998.SH	中信银行	1.16	19.24	30.96	002313.SZ	日海通讯	-0.20	9.96	29.90
5	000877.SZ	天山股份	-0.29	18.63	34.75	601808.SH	中海油服	-0.24	9.45	3.49
6	600757.SH	长江传媒	-0.23	17.08	19.78	600104.SH	上汽集团	1.04	8.87	22.12
7	600104.SH	上汽集团	1.04	16.14	40.27	600009.SH	上海机场	0.22	8.64	8.45
8	601333.SH	广深铁路	0.00	15.69	17.36	601398.SH	工商银行	0.45	8.59	30.87

9	601288.SH	农业银行	0.63	15.30	36.48	600196.SH	复星医药	1.20	7.59	13.62
10	600146.SH	商赢环球	-0.09	14.45	25.04	000060.SZ	中金岭南	0.75	7.48	27.99
11	600478.SH	科力远	2.62	14.35	34.23	002461.SZ	珠江啤酒	0.85	6.65	6.41
12	600999.SH	招商证券	1.62	13.67	141.75	600316.SH	洪都航空	0.94	6.62	14.54
13	000001.SZ	平安银行	0.11	12.92	64.28	600584.SH	长电科技	0.36	6.60	10.66
14	000685.SZ	中山公用	-0.09	12.73	10.85	600729.SH	重庆百货	0.08	5.83	6.24
15	600867.SH	通化东宝	0.21	12.67	15.23	300124.SZ	汇川技术	0.75	5.71	8.63
16	002475.SZ	立讯精密	0.09	12.24	23.38	600028.SH	中国石化	0.60	5.71	20.67
17	002269.SZ	美邦服饰	-0.93	12.18	5.09	000718.SZ	苏宁环球	-1.08	5.62	10.73
18	600597.SH	光明乳业	0.50	11.94	20.90	601012.SH	隆基股份	0.29	5.51	8.23
19	000750.SZ	国海证券	0.28	11.92	72.60	600568.SH	中珠控股	1.56	5.49	6.92
20	601398.SH	工商银行	0.45	11.90	42.74	600197.SH	伊力特	0.26	5.46	8.06

数据来源: wind、信达证券研发中心。

上一交易日,两融标的股票中融资余额占流通市值比例前十名为全柴动力(22.16%)、北纬通信(21.23%)、锦富新材(20.3%)等,融资余额占流通市值比例增速前十名为世界荣兆业(+16.17%)、齐翔腾达(+13.08%)、国栋建设(+10.85%)等。

图表 11: 上一交易日融资余额占流通市值比例及增速排名前 10 标的股票

排名	占比前 10			增速前 10		
	股票代码	股票简称	融资余额占流通市值比例 (%)	股票代码	股票简称	占比增速 (%)
1	600218.SH	全柴动力	22.16	002016.SZ	世荣兆业	16.17
2	002148.SZ	北纬通信	21.23	002408.SZ	齐翔腾达	13.08
3	300128.SZ	锦富新材	20.30	600321.SH	国栋建设	10.85
4	300077.SZ	国民技术	19.94	002400.SZ	省广股份	9.06
5	300093.SZ	金刚玻璃	19.35	300077.SZ	国民技术	8.46
6	300228.SZ	富瑞特装	19.18	600066.SH	宇通客车	8.44
7	000554.SZ	泰山石油	19.14	002311.SZ	海大集团	7.34
8	000996.SZ	中国中期	19.02	601118.SH	海南橡胶	7.21
9	002369.SZ	卓翼科技	18.98	600716.SH	凤凰股份	7.14
10	300074.SZ	华平股份	18.80	600113.SH	浙江东日	7.13

数据来源: wind、信达证券研发中心

## 5. 标的股票大宗交易

上一交易日,发生大宗交易的标的股票有美的集团、上海莱士、洋河股份等 11 只。

图表 12: 上一交易日发生大宗交易标的股票

编号	股票代码	股票简称	成交价	前一交易日收盘价	折价率 (%)	当日收盘价	成交量(万股/份/张)	成交额(万元)
1	000333.SZ	美的集团	24.01	26.68	-10.01	26.76	394.00	9459.94
2	002252.SZ	上海莱士	19.71	21.90	-10.00	21.82	300.00	5913.00
3	002304.SZ	洋河股份	69.80	69.39	0.59	69.80	45.00	3141.00
4	002431.SZ	棕榈股份	10.39	10.88	-4.50	10.66	1000.00	10390.00
5	300003.SZ	乐普医疗	18.10	18.78	-3.62	18.47	300.00	5430.00
6	300020.SZ	银江股份	17.78	18.89	-5.88	18.42	500.00	8890.00
7	600177.SH	雅戈尔	14.56	14.53	0.21	14.54	173.36	2524.12
8	600266.SH	北京城建	13.00	13.32	-2.40	13.35	220.00	2860.00

9	600352.SH	浙江龙盛	9.21	9.25	-0.43	9.20	316.40	2914.04
10	600363.SH	联创光电	17.92	17.92	0.00	17.93	221.80	3974.66
11	600827.SH	百联股份	12.98	12.88	0.78	12.92	18.26	237.04

数据来源: wind、信达证券研发中心

## 二、今日标的股票事件提示

### 1. 标的股票停复牌

今日共有 41 只标的股票停牌，其中今日开始停牌股票有云南城投等 1 只，今日复牌股票有云南铜业等 1 只。

图表 13: 复牌及停牌标的股票

序号	股票代码	股票简称	交易状态	停牌起始日	连停天数	期间指数涨跌幅(%)	涉及事件
1	000878.SZ	云南铜业	复牌	2016-10-18	13	2.07	重大事项
2	600239.SH	云南城投	停牌	2016-10-31	0	0.00	
3	600797.SH	浙大网新	停牌	2016-10-27	4	-0.39	重要事项未公告
4	002440.SZ	闰土股份	停牌	2016-10-24	7	0.43	重大事项
5	600331.SH	宏达股份	停牌	2016-10-21	10	0.64	重要事项未公告
6	600663.SH	陆家嘴	停牌	2016-10-19	12	0.66	拟筹划重大资产重组
7	601238.SH	广汽集团	停牌	2016-10-18	13	2.07	重要事项未公告
8	000563.SZ	陕国投 A	停牌	2016-10-14	17	1.40	重大资产重组
9	600432.SH	*ST 吉恩	停牌	2016-10-13	18	1.50	重大资产重组
10	600893.SH	中航动力	停牌	2016-10-11	20	1.84	重要事项未公告
11	000829.SZ	天音控股	停牌	2016-09-29	32	3.90	重大事项
12	600390.SH	*ST 金瑞	停牌	2016-09-29	32	3.90	重大资产重组
13	600525.SH	长园集团	停牌	2016-09-29	32	3.90	重大资产重组
14	600859.SH	王府井	停牌	2016-09-27	34	4.16	拟筹划重大资产重组
15	300027.SZ	华谊兄弟	停牌	2016-09-26	35	2.32	重大资产重组
16	000415.SZ	渤海租赁	停牌	2016-09-23	38	2.04	重大资产重组
17	002642.SZ	荣之联	停牌	2016-09-22	39	2.59	重大资产重组
18	000050.SZ	深天马 A	停牌	2016-09-12	49	0.83	重大资产重组
19	002025.SZ	航天电器	停牌	2016-09-12	49	0.83	重大资产重组
20	002396.SZ	星网锐捷	停牌	2016-09-12	49	0.83	拟披露重大事项
21	300088.SZ	长信科技	停牌	2016-09-12	49	0.83	重大资产重组
22	300273.SZ	和佳股份	停牌	2016-09-08	53	0.40	重大资产重组
23	601727.SH	上海电气	停牌	2016-08-31	61	0.96	重要事项未公告
24	600021.SH	上海电力	停牌	2016-08-24	68	0.47	重要事项未公告
25	002055.SZ	得润电子	停牌	2016-08-16	76	-0.67	重大事项
26	000812.SZ	陕西金叶	停牌	2016-08-11	81	2.83	重大资产重组
27	000100.SZ	TCL 集团	停牌	2016-08-04	88	4.22	重大资产重组
28	002571.SZ	德力股份	停牌	2016-08-02	90	5.11	重大资产重组
29	000538.SZ	云南白药	停牌	2016-07-19	104	1.99	重大事项
30	601101.SH	昊华能源	停牌	2016-07-11	112	3.89	重大资产重组
31	600773.SH	西藏城投	停牌	2016-06-30	123	5.89	重大资产重组
32	002574.SZ	明牌珠宝	停牌	2016-06-27	126	8.76	重大资产重组

33	600675.SH	*ST 中企	停牌	2016-06-24	129	7.34	重大资产重组
34	601005.SH	重庆钢铁	停牌	2016-06-02	151	6.55	重大资产重组
35	600545.SH	新疆城建	停牌	2016-05-31	153	9.98	重大资产重组
36	600330.SH	天通股份	停牌	2016-05-23	161	9.87	拟筹划重大资产重组
37	600636.SH	三爱富	停牌	2016-05-09	175	6.56	重大资产重组
38	000511.SZ	烯碳新材	停牌	2016-04-26	188	5.35	重大事项
39	002129.SZ	中环股份	停牌	2016-04-25	189	4.90	重大事项
40	000975.SZ	银泰资源	停牌	2016-04-19	195	2.33	重大资产重组
41	000693.SZ	ST 华泽	停牌	2016-03-01	244	15.49	重大事项
42	600209.SH	罗顿发展	停牌	2016-02-24	250	6.92	重大资产重组

数据来源: wind、信达证券研发中心。

注: 期间指数涨跌幅指的是停牌期间上证指数涨跌幅。

## 2. 大股东增减持标的股票

今日披露, 大股东增持标的股票有廊坊发展、上海家化等 2 只, 无大股东减持标的股票。

图表 14: 大股东持股比例变动标的股票

编号	股票代码	股票简称	公告日期	变动截止日期	变动方向	变动数量占流通股比 (%)	通过大宗交易变动比例 (%)	变动后持股比例 (%)	交易平均价	变动期间股票均价	前涨跌幅 (%)
1	600149.SH	廊坊发展	2016/10/31	2016/10/28	增持	5.00	0.00	20.00	29.35	29.18	3.73
2	600315.SH	上海家化	2016/10/29	2016/10/28	增持	0.50	0.00	3.43	26.77	26.68	0.38

数据来源: wind、信达证券研发中心

## 3. 标的股票增发

今日披露, 共有 5 只标的股票涉及增发事件, 其中新疆城建、云南铜业等 2 只发布董事会预案, 号百控股等 1 只股东大会通过, 没有股票涉及增发公告日, 沃尔核材、大富科技等 2 只为增发股份上市日。

图表 15: 未来七个交易日标的股票增发

序号	股票代码	股票简称	时间	事件	事件价格	增发方式	前收盘价	前涨跌幅 (%)
1	002130.SZ	沃尔核材	2016-10-28	增股上市日	15.09	定向	15.07	-0.40
2	300134.SZ	大富科技	2016-10-26	增股上市日	30.63	定向	30.20	0.17
3	600640.SH	号百控股	2016-10-29	股东大会通过	14.45	定向	21.32	-2.91
4	600545.SH	新疆城建	2016-10-31	董事会预案	6.44	定向	6.86	0.00
5	000878.SZ	云南铜业	2016-10-29	董事会预案		定向	10.41	0.00

数据来源: wind、信达证券研发中心

## 4. 标的股票分红送转

今日披露, 没有标的股票涉及分红送转事件。

图表 16: 未来七个交易日发生分红送转事件标的股票

序号	股票代码	股票简称	时间	是否分红	每股股利 (税前)	事件	前收盘价 (元)	前涨跌幅 (%)	股息率 (%)	每股红股及转增股本
1										

数据来源: wind、信达证券研发中心

## 5. 发布相关业绩报告的标的股票

今日共有兴业矿业、天音控股、苏宁云商等 72 只标的股票发布业绩预告。

图表 17: 今日发布相关业绩报告的标的股票

序号	股票代码	股票简称	报告类型	业绩预告类型	同比增长(%)	前收盘价	前涨跌幅(%)
1	000426.SZ	兴业矿业	年度报告	扭亏	583.01	9.72	-1.42
2	000829.SZ	天音控股	年度报告	扭亏	170.33	11.28	0.00
3	002024.SZ	苏宁云商	年度报告	首亏	-134.80	11.25	-1.40
4	002030.SZ	达安基因	年度报告	续盈	20.00	26.78	-0.85
5	002055.SZ	得润电子	年度报告	续盈	-20.00	31.96	0.00
6	002067.SZ	景兴纸业	年度报告	预增	1945.06	7.26	-1.76
7	002069.SZ	*ST 獐岛	年度报告	扭亏	122.64	11.01	-1.26
8	002130.SZ	沃尔核材	年度报告	预减	-85.00	15.07	-0.40
9	002154.SZ	报喜鸟	年度报告	首亏	-489.93	5.10	-1.16
10	002161.SZ	远望谷	年度报告	预增	110.00	12.77	-2.00
11	002183.SZ	怡亚通	年度报告	略增	50.00	12.58	-2.56
12	002185.SZ	华天科技	年度报告	略增	30.00	12.81	-1.31
13	002202.SZ	金风科技	年度报告	略增	50.00	16.03	-0.80
14	002244.SZ	滨江集团	年度报告	略增	40.00	6.75	-0.30
15	002251.SZ	步步高	年度报告	续盈	-20.00	14.25	-4.10
16	002273.SZ	水晶光电	年度报告	预增	70.00	23.29	-1.65
17	002292.SZ	奥飞动漫	年度报告	略增	30.00	27.73	-0.07
18	002308.SZ	威创股份	年度报告	预增	60.00	16.60	-0.36
19	002325.SZ	洪涛股份	年度报告	续盈	-40.00	9.62	-1.84
20	002340.SZ	格林美	年度报告	略增	50.00	7.17	-0.97
21	002375.SZ	亚厦股份	年度报告	略减	-50.00	11.55	-1.37
22	002378.SZ	章源钨业	年度报告	扭亏	130.00	10.66	0.19
23	002385.SZ	大北农	年度报告	预增	70.00	7.37	0.14
24	002399.SZ	海普瑞	年度报告	预减	-60.00	18.60	-1.80
25	002419.SZ	天虹商场	年度报告	预减	-70.00	12.91	-0.46
26	002456.SZ	欧菲光	年度报告	预增	80.00	38.37	-1.54
27	002570.SZ	贝因美	年度报告	首亏	-495.60	11.77	-1.34
28	002577.SZ	雷柏科技	年度报告	扭亏	109.64	39.17	-2.07
29	002594.SZ	比亚迪	年度报告	预增	84.17	56.26	-0.60
30	300002.SZ	神州泰岳	年度报告	预增	110.00	10.53	-2.23
31	300124.SZ	汇川技术	年度报告	略增	30.00	20.27	0.75
32	300228.SZ	富瑞特装	年度报告	首亏	0.00	15.60	-1.14
33	600010.SH	宝钢股份	年度报告	不确定	0.00	2.82	-1.05
34	600058.SH	五矿发展	年度报告	不确定	0.00	16.88	-1.92
35	600088.SH	中视传媒	年度报告	首亏	0.00	23.52	-1.67
36	600119.SH	长江投资	年度报告	不确定	0.00	23.65	-0.13
37	600139.SH	西部资源	年度报告	续亏	0.00	12.92	-0.84
38	600146.SH	商赢环球	年度报告	扭亏	0.00	34.06	-0.09
39	600150.SH	中国船舶	年度报告	首亏	0.00	23.24	-0.77
40	600169.SH	太原重工	年度报告	首亏	0.00	4.19	-1.41
41	600198.SH	大唐电信	年度报告	首亏	0.00	19.32	-1.18

42	600209.SH	罗顿发展	年度预告	首亏	0.00	11.13	0.00
43	600259.SH	广晟有色	年度预告	不确定	0.00	50.70	-1.50
44	600293.SH	三峡新材	年度预告	扭亏	0.00	14.80	2.71
45	600390.SH	*ST金瑞	年度预告	扭亏	0.00	14.95	0.00
46	600392.SH	盛和资源	年度预告	首亏	0.00	14.03	-1.82
47	600503.SH	华丽家族	年度预告	预增	0.00	9.56	-1.75
48	600594.SH	益佰制药	年度预告	预增	100.00	16.71	-0.59
49	600596.SH	新安股份	年度预告	扭亏	0.00	8.54	-2.84
50	600624.SH	复旦复华	年度预告	不确定	0.00	8.71	-1.14

数据来源: wind、信达证券研发中心

## 6. 标的股票限售股解禁

未来7个交易日共有盛运环保、大富科技、新大陆等7只标的股票涉及限售股解禁。

图表 18: 未来七个交易日标的股票限售解禁

序号	股票代码	股票简称	解禁时间	解禁数量(万股)	占解禁前A股流通股比	流通股份类型	前收盘价	前涨跌幅(%)
1	300090.SZ	盛运环保	2016/10/31	9163.99	11.65	定向增发机构配售股份	10.49	-3.58
2	300134.SZ	大富科技	2016/10/31	11469.80	16.10	定向增发机构配售股份	30.20	0.17
3	000997.SZ	新大陆	2016/11/1	517.37	0.56	股权激励限售股份	18.70	-0.85
4	600521.SH	华海药业	2016/11/3	268.09	0.26	股权激励限售股份	25.49	0.35
5	600038.SH	中直股份	2016/11/4	19682.67	50.13	定向增发机构配售股份	43.34	-0.76
6	300001.SZ	特锐德	2016/11/7	7122.61	8.64	定向增发机构配售股份	19.83	0.46
7	600976.SH	健民集团	2016/11/8	6.96	0.05	股权激励限售股份	32.04	-2.08

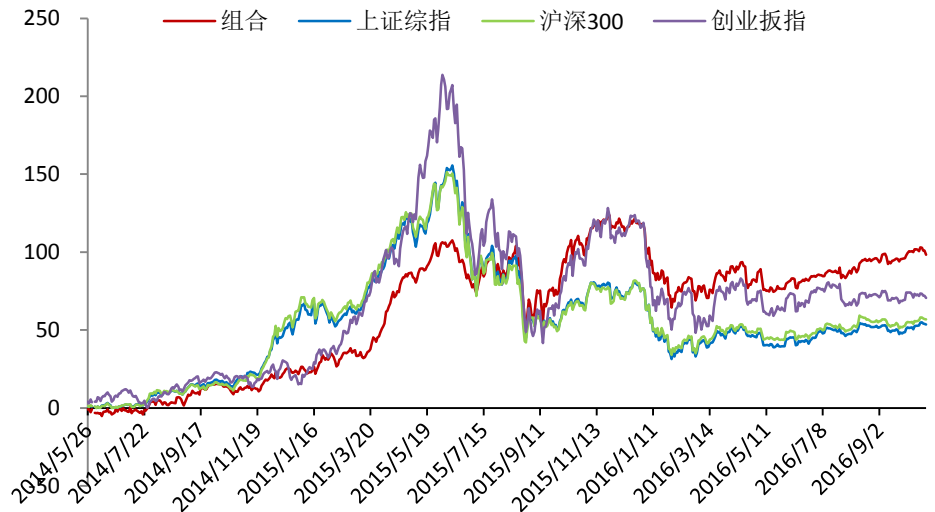
数据来源: wind、信达证券研发中心

## 三、事件投资组合操作

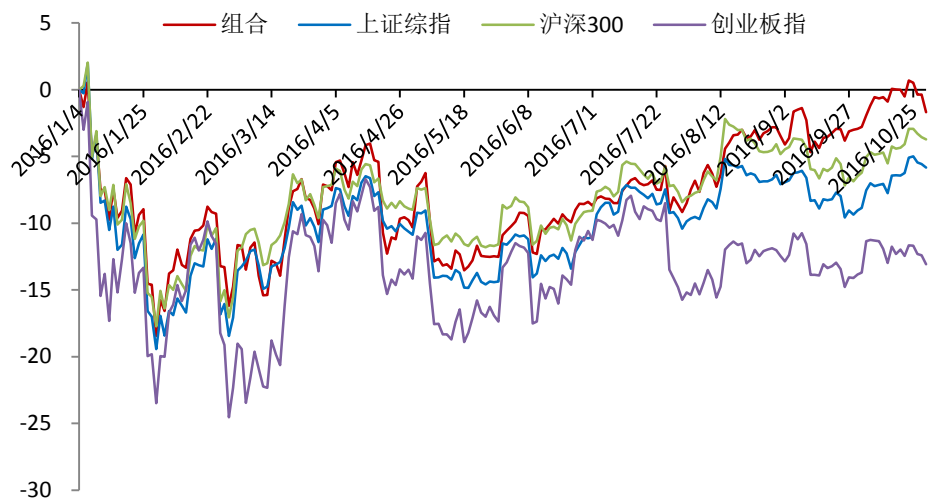
说明: 本事件投资组合是由信达证券事件选股模型针对本报告第一、第二部分事件内容筛选而形成。组合单只股票权重按总资产3%计,开始日期为2014年5月23日,不考虑交易费用,每日盘前制定当日投资操作,股票买入与卖出的价格按当日均价执行。

### 1. 组合历史收益

上一交易日组合收益率为-1.32%,至2016年10月28日组合累计收益率为98.27%,分别超越上证综指、沪深300及创业板指44.69、41.52及27.7个百分点。

**图表 19: 组合历史收益曲线**


数据来源: wind、信达证券研发中心

**图表 20: 组合今年以来收益曲线**


数据来源: wind、信达证券研发中心

**图表 21: 组合历史收益对比**

收益率	近一周%	近一月%	近三月%	近六月%	近一年%	今年以来%
组合	-1.19	1.61	6.27	8.97	-3.20	-1.68
上证综指	0.64	2.69	2.15	5.10	-9.61	-5.82
沪深300	0.65	2.54	2.69	5.50	-7.03	-3.72
创业板指	-1.27	0.32	-4.40	0.88	-15.54	-13.08

数据来源: wind、信达证券研发中心

## 2. 今日组合操作

### 1) 今日拟建仓股票

今日建仓股票: 景兴纸业(业绩预增)、威创股份(业绩预增)。

**图表 22: 今日拟建仓股票**

序号	股票代码	股票简称	权重(%)	昨日涨幅(%)	建仓理由
1	002067.SZ	景兴纸业	3.00	-1.76	业绩预增
2	002308.SZ	威创股份	3.00	-0.36	业绩预增

数据来源: wind、信达证券研发中心

## 2) 今日拟平仓股票

今日拟平仓股票有福星股份、中粮屯河等 2 只。

**图表 23: 今日拟平仓股票**

序号	股票代码	股票简称	买入日期	权重(%)	持有期收益率(%)
1	000926.SZ	福星股份	2016/9/26	3.00	4.40
2	600737.SH	中粮屯河	2016/9/27	3.00	-3.08

数据来源: wind、信达证券研发中心

## 3. 昨日组合操作回顾

### 1) 昨日建仓股票

昨日无成功建仓股票。

**图表 24: 昨日建仓股票**

序号	股票代码	简称	买入价格	权重(%)	建仓理由
1					

数据来源: wind、信达证券研发中心

### 2) 昨日平仓股票

昨日无平仓股票。

**图表 25: 昨日平仓股票**

序号	股票代码	股票简称	建仓日期	买入价格	权重(%)	卖出价格	持有期收益率(%)
1							

数据来源: wind、信达证券研发中心

## 4. 组合成分股

至 2016 年 10 月 28 日收盘, 组合共有成分股 33 只, 仓位 99.01%。

**图表 26: 组合成分股**

序号	股票代码	股票简称	买入日期	买入价格	权重(%)	昨日价格	浮动收益率(%)	相对收益率(%)
1	002355.SZ	兴民智通	2016/3/28	19.03	3.00	17.12	-10.04	-14.23
2	002129.SZ	中环股份	2016/4/1	8.92	3.00	8.27	-7.33	-10.67
3	002221.SZ	东华能源	2016/8/24	12.93	3.00	13.26	2.55	2.08
4	000926.SZ	福星股份	2016/9/26	12.10	3.00	12.63	4.40	2.08
5	600737.SH	中粮屯河	2016/9/27	12.05	3.00	11.68	-3.08	-7.23
6	600771.SH	广誉远	2016/9/29	34.08	3.00	33.20	-2.57	-6.46
7	600661.SH	新南洋	2016/9/30	28.95	3.00	32.92	13.70	10.18
8	002408.SZ	齐翔腾达	2016/10/11	6.19	3.00	6.69	8.12	6.28
9	300072.SZ	三聚环保	2016/10/11	47.11	3.00	43.95	-6.71	-8.55
10	600522.SH	中天科技	2016/10/11	11.43	3.00	11.04	-3.42	-5.26
11	000537.SZ	广宇发展	2016/10/12	8.97	3.00	8.90	-0.83	-2.11
12	600309.SH	万华化学	2016/10/12	21.23	3.00	21.39	0.76	-0.51

13	601168.SH	西部矿业	2016/10/12	7.27	3.00	7.33	0.87	-0.41
14	000012.SZ	南玻 A	2016/10/13	11.42	3.00	11.61	1.69	0.19
15	000551.SZ	创元科技	2016/10/13	10.28	3.00	10.38	0.95	-0.55
16	000061.SZ	农产品	2016/10/14	12.30	3.00	12.40	0.83	-0.57
17	300002.SZ	神州泰岳	2016/10/14	11.21	3.00	10.53	-6.02	-7.43
18	300205.SZ	天喻信息	2016/10/14	15.16	3.00	14.64	-3.40	-4.81
19	300253.SZ	卫宁健康	2016/10/14	22.49	3.00	22.36	-0.56	-1.96
20	000938.SZ	紫光股份	2016/10/17	64.26	3.00	61.54	-4.23	-5.56
21	300010.SZ	立思辰	2016/10/17	18.91	3.00	19.91	5.29	3.97
22	300020.SZ	银江股份	2016/10/17	19.50	3.00	18.42	-5.54	-6.86
23	300058.SZ	蓝色光标	2016/10/17	10.94	3.00	10.55	-3.61	-4.93
24	600872.SH	中炬高新	2016/10/18	16.11	3.00	16.59	2.98	0.90
25	002230.SZ	科大讯飞	2016/10/18	28.94	3.00	29.91	3.34	1.27
26	600073.SH	上海梅林	2016/10/18	12.07	3.00	11.95	-1.03	-3.11
27	600176.SH	中国巨石	2016/10/19	11.27	3.00	10.87	-3.57	-4.23
28	002050.SZ	三花股份	2016/10/19	11.43	3.00	10.65	-6.86	-7.52
29	600200.SH	江苏吴中	2016/10/20	18.88	3.00	18.50	-2.01	-2.64
30	600210.SH	紫江企业	2016/10/20	5.55	3.00	5.48	-1.23	-1.86
31	002176.SZ	江特电机	2016/10/21	12.78	3.00	12.25	-4.16	-4.80
32	002474.SZ	榕基软件	2016/10/21	17.13	3.00	16.20	-5.45	-6.10
33	002118.SZ	紫鑫药业	2016/10/24	8.29	3.00	8.53	2.86	2.43

数据来源: wind、信达证券研发中心

注: 相对收益率是成分股相对同期上证综指的持有期收益率。

## 分析师简介

**俞雪飞博士**，金融工程高级分析师，从事证券研究 15 年，主要进行基金、股指期货、量化投资及证券行业创新业务等领域专题研究。具有扎实的证券研究理论基础、丰富的投资实践经验及出色的科研项目组织能力。作为负责人，先后在 2002 年度、2007 年度、2008 年度及 2010 年度中国证券业协会科研课题研究中获奖。

## 分析师声明

负责本报告全部或部分内容的每一位分析师在此申明，本人具有证券投资咨询执业资格，并在中国证券业协会注册登记为证券分析师，以勤勉的职业态度，独立、客观地出具本报告；本报告所表述的所有观点准确反映了分析师本人的研究观点；本人薪酬的任何组成部分不曾与，不与，也将不会与本报告中的具体分析意见或观点直接或间接相关。

## 免责声明

信达证券股份有限公司(以下简称“信达证券”)具有中国证监会批复的证券投资咨询业务资格。本报告由信达证券制作并发布。

本报告是针对与信达证券签署服务协议的签约客户的专属研究产品，为该类客户进行投资决策时提供辅助和参考，双方对权利与义务均有严格约定。本报告仅提供给上述特定客户，并不面向公众发布。信达证券不会因接收人收到本报告而视其为本公司的当然客户。客户应当认识到有关本报告的电话、短信、邮件提示仅为研究观点的简要沟通，对本报告的参考使用须以本报告的完整版本为准。

本报告是基于信达证券认为可靠的已公开信息编制，但信达证券不保证所载信息的准确性和完整性。本报告所载的意见、评估及预测仅为本报告最初出具日的观点和判断，本报告所指的证券或投资标的的价格、价值及投资收入可能会出现不同程度的波动，涉及证券或投资标的的历史表现不应作为日后表现的保证。在不同时期，或因使用不同假设和标准，采用不同观点和分析方法，致使信达证券发出与本报告所载意见、评估及预测不一致的研究报告，对此信达证券可不发出特别通知。

在任何情况下，本报告中的信息或所表述的意见并不构成对任何人的投资建议，也没有考虑到客户特殊的投资目标、财务状况或需求。客户应考虑本报告中的任何意见或建议是否符合其特定状况，若有必要应寻求专家意见。本报告所载的资料、工具、意见及推测仅供参考，并非作为或被视为出售或购买证券或其他投资标的的邀请或向人做出邀请。

在法律允许的情况下，信达证券或其关联机构可能会持有报告中涉及的公司所发行的证券并进行交易，并可能会为这些公司正在提供或争取提供投资银行业务服务。

本报告版权仅为信达证券所有。未经信达证券书面同意，任何机构和个人不得以任何形式翻版、复制、发布、转发或引用本报告的任何部分。若信达证券以外的机构向其客户发放本报告，则由该机构独自为此发送行为负责，信达证券对此等行为不承担任何责任。本报告同时不构成信达证券向发送本报告的机构之客户提供的投资建议。

如未经信达证券授权，私自转载或者转发本报告，所引起的一切后果及法律责任由私自转载或转发者承担。信达证券将保留随时追究其法律责任的权利。

## 风险提示

证券市场是一个风险无时不在的市场。投资者在进行证券交易时存在赢利的可能，也存在亏损的风险。建议投资者应当充分深入地了解证券市场蕴含的各项风险并谨慎行事。

本报告中所述证券不一定能在所有的国家和地区向所有类型的投资者销售，投资者应当对本报告中的信息和意见进行独立评估，并应同时考量各自的投资目的、财务状况和特定需求，必要时就法律、商业、财务、税收等方面咨询专业顾问的意见。在任何情况下，信达证券不对任何人因使用本报告中的任何内容所引致的任何损失负任何责任，投资者需自行承担风险。

## 机构销售联系人

区域	姓名	办公电话	手机	邮箱
华北	袁 泉	010-63081270	13671072405	yuanq@cindasc.com
华北	张 华	010-63081254	13691304086	zhanghuac@cindasc.com
华北	饶婷婷	010-63081479	18211184073	raotingting@cindasc.com
华北	何 欢	010-63081150	18610718799	hehuan@cindasc.com
华北	巩婷婷	010-63081128	13811821399	gongtingting@cindasc.com
华东	文襄琳	021-63570071	13681810356	wenxianglin@cindasc.com
华东	王莉本	021-61678592	18121125183	wangliben@cindasc.com
华南	刘 晟	0755-82465035	13825207216	liusheng@cindasc.com
华南	易耀华	0755-82497333	18680307697	yiyahua@cindasc.com
国际	唐 蕾	010-63080945	18610350427	tanglei@cindasc.com