

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

2017年6月12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 8651.22 亿元(-0.2%), 其中融资余额规模为 8606.09 亿元(-0.2%), 融券余额规模为 45.13 亿元(+0.47%)。从融资规模来看, 上一交易日沪深两市融资买入额为 335.8 亿元(-6.36%), 融资偿还额为 353.13 亿元(+0.23%)。
- 上一交易日, 市场指数中小板指(+0.61%)表现最好, 创业板指(+0.08%)表现最弱; 从行业来看, 建筑装饰(+1.06%)、电气设备(+0.64%)、食品饮料(+0.61%)、计算机(+0.58%)、纺织服装(+0.55%)等行业表现较好, 家用电器(-0.33%)、钢铁(-0.31%)、房地产(-0.09%)、化工(-0.02%)、农林牧渔(-0.01%)等行业表现较弱。
- 两融标的股票中, 涨幅前五名为: 游久游戏(+10.05%)、国电南瑞(+9.99%)、二六三(+9.95%)、德豪润达(+8.04%)和美尔雅(+7.12%); 跌幅前五名为: 盾安环境(-6.33%)、德力股份(-4.99%)、盐田港(-4.33%)、棕榈股份(-3.88%)和东方金钰(-3.55%); 五日量比前五名为: 强生控股(6.49)、三一重工(4.37)、上海家化(4.19)、大众交通(3.9)和洪涛股份(3.77)。
- 上一交易日, 发生大宗交易的标的股票有长安汽车、广发证券、东方雨虹等 11 只。
- 今日共有 50 只标的股票停牌, 其中今日没有开始停牌股票, 今日复牌股票有锦龙股份、大智慧、万科 A 等 4 只。
- 今日披露, 大股东增持标的股票有华意压缩、阳光城、长园集团等 5 只, 大股东减持标的股票有长园集团等 1 只。
- 今日披露, 共有 3 只标的股票涉及增发事件, 其中新华医疗等 1 只发布董事会预案, 中集集团、新潮能源等 2 只股东大会通过, 没有股票涉及增发公告日, 没有股票涉及增发股份上市日。
- 今日披露, 共有 101 只标的股票涉及分红送转事件, 其中有中成股份、鲁泰 A、广汇能源等 5 只股东大会通过, 桂林三金、日照港、华夏幸福等 15 只为实施公告日, 仁和药业、中集集团、申万宏源等 65 只为股权登记日, 中航飞机、高鸿股份、华邦健康等 16 只为除权除息日。
- 今日无标的股票业绩报告发布。
- 未来 7 个交易日共有华意压缩、温氏股份、劲嘉股份等 17 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: 无。
- 今日无拟平仓股票。
- 上一交易日组合收益率为 0.07%, 至 2017 年 6 月 9 日组合累计收益率为 100.15%, 分别超越上证综指、沪深 300 及创业板指 43.89、32.32 及 58.67 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..... | 12 |
| 5. 发布相关业绩报告的标的股票..... | 14 |
| 6. 标的股票限售股解禁..... | 14 |
| 三、事件投资组合操作..... | 15 |
| 1. 组合历史收益..... | 15 |
| 2. 今日组合操作..... | 16 |
| 3. 昨日组合操作回顾..... | 16 |
| 4. 组合成分股..... | 17 |

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..... | 12 |
| 图表 16: 未来七个交易日发生分红送转事件标的股票..... | 12 |
| 图表 17: 今日发布相关业绩报告的标的股票 | 14 |
| 图表 18: 未来七个交易日标的股票限售解禁 | 14 |
| 图表 19: 组合历史收益曲线..... | 15 |
| 图表 20: 组合今年以来收益曲线..... | 16 |
| 图表 21: 组合历史收益对比..... | 16 |
| 图表 22: 今日拟建仓股票 | 16 |

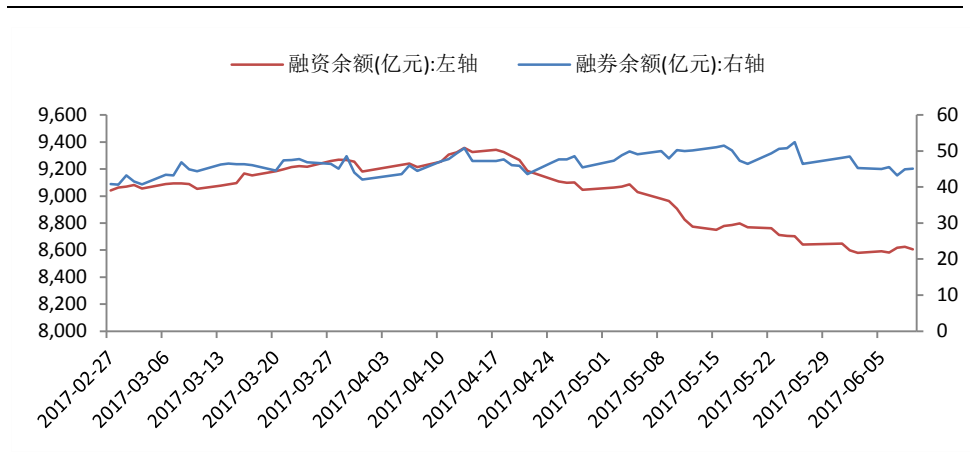
| | |
|---------------------|----|
| 图表 23: 今日拟平仓股票..... | 16 |
| 图表 24: 昨日建仓股票..... | 17 |
| 图表 25: 昨日平仓股票..... | 17 |
| 图表 26: 组合成分股..... | 17 |

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 8651.22 亿元(-0.2%)，其中融资余额规模为 8606.09 亿元(-0.2%)，融券余额规模为 45.13 亿元(+0.47%)。

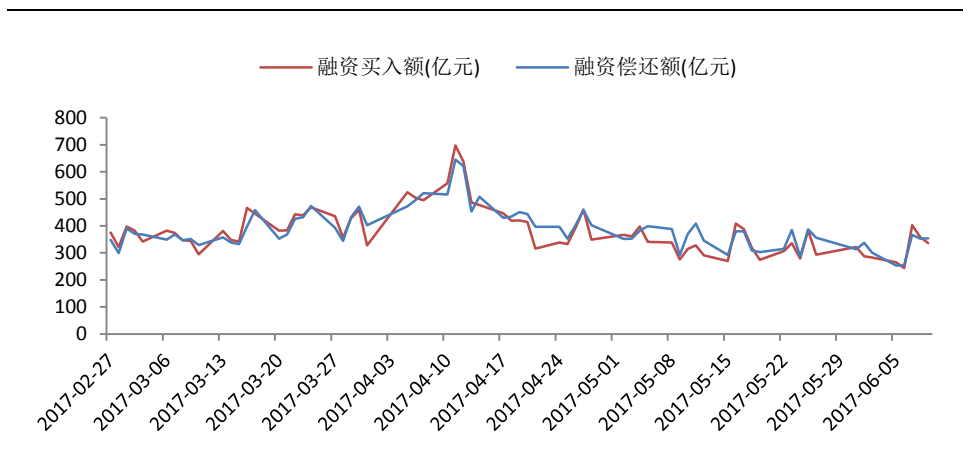
图表 1：近三月每日融资融券余额规模（亿元）



数据来源：wind、信达证券研发中心

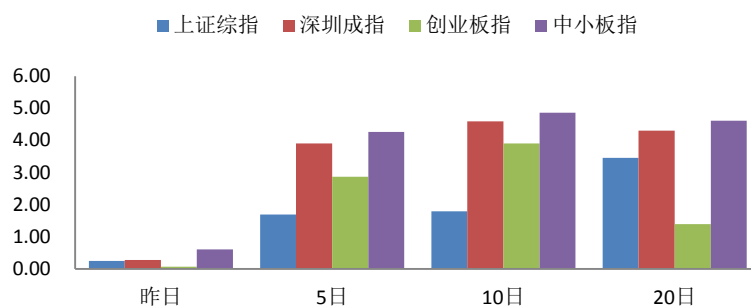
从融资规模来看，上一交易日沪深两市融资买入额为 335.8 亿元(-6.36%)，融资偿还额为 353.13 亿元(+0.23%)。

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，市场指数中小板指表现较好，上涨 0.61%，创业板指表现最弱，上涨 0.08%；从 5 日涨跌幅看，中小板指表现较好，上涨 4.27%，上证综指表现最弱，上涨 1.7%；从 10 日涨跌幅看，中小板指表现较好，上涨 4.87%，上证综指表现最弱，上涨 1.8%；从 20 日涨跌幅看，中小板指表现较好，上涨 4.62%，创业板指表现最弱，上涨 1.4%。

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, 纺织服装(+0.65%)、化工(+0.26%)、有色金属(-0.06%)等行业增速居前, 非银金融(-1.55%)、电气设备(-1.75%)、建筑装饰(-2.12%)等行业增速靠后。

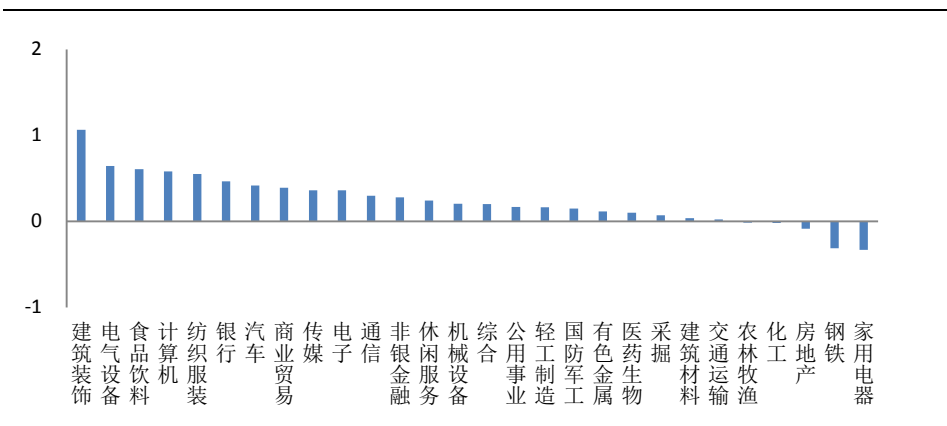
图表 4: 上一交易日两融标的股票分行业融资余额占流通市值比例及增速 (%)

| 序号 | 代码 | 行业 | 融资余额占流通市值比例(%) | 占比增速(%) |
|----|-----------|------|----------------|---------|
| 1 | 801130.SI | 纺织服装 | 3.20 | 0.65 |
| 2 | 801030.SI | 化工 | 3.00 | 0.26 |
| 3 | 801050.SI | 有色金属 | 5.71 | -0.06 |
| 4 | 801170.SI | 交通运输 | 2.08 | -0.07 |
| 5 | 801760.SI | 传媒 | 6.68 | -0.08 |
| 6 | 801210.SI | 休闲服务 | 2.19 | -0.12 |
| 7 | 801160.SI | 公用事业 | 2.65 | -0.16 |
| 8 | 801010.SI | 农林牧渔 | 3.46 | -0.17 |
| 9 | 801230.SI | 综合 | 8.61 | -0.25 |
| 10 | 801150.SI | 医药生物 | 2.92 | -0.26 |
| 11 | 801780.SI | 银行 | 0.86 | -0.30 |
| 12 | 801180.SI | 房地产 | 3.68 | -0.31 |
| 13 | 801200.SI | 商业贸易 | 5.24 | -0.35 |
| 14 | 801110.SI | 家用电器 | 1.94 | -0.42 |
| 15 | 801020.SI | 采掘 | 0.84 | -0.42 |
| 16 | 801740.SI | 国防军工 | 4.23 | -0.44 |
| 17 | 801890.SI | 机械设备 | 3.80 | -0.45 |
| 18 | 801880.SI | 汽车 | 2.45 | -0.57 |
| 19 | 801770.SI | 通信 | 4.92 | -0.64 |
| 20 | 801080.SI | 电子 | 5.02 | -0.66 |
| 21 | 801140.SI | 轻工制造 | 6.15 | -0.75 |
| 22 | 801120.SI | 食品饮料 | 1.17 | -0.82 |
| 23 | 801710.SI | 建筑材料 | 4.86 | -0.84 |
| 24 | 801040.SI | 钢铁 | 2.55 | -0.93 |
| 25 | 801750.SI | 计算机 | 5.60 | -1.43 |
| 26 | 801790.SI | 非银金融 | 2.34 | -1.55 |
| 27 | 801730.SI | 电气设备 | 4.08 | -1.75 |
| 28 | 801720.SI | 建筑装饰 | 2.34 | -2.12 |

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,建筑装饰(+1.06%)、电气设备(+0.64%)、食品饮料(+0.61%)、计算机(+0.58%)、纺织服装(+0.55%)等行业表现较好,家用电器(-0.33%)、钢铁(-0.31%)、房地产(-0.09%)、化工(-0.02%)、农林牧渔(-0.01%)等行业表现较弱。

图表 5: 申万行业上一交易日涨跌幅 (%)

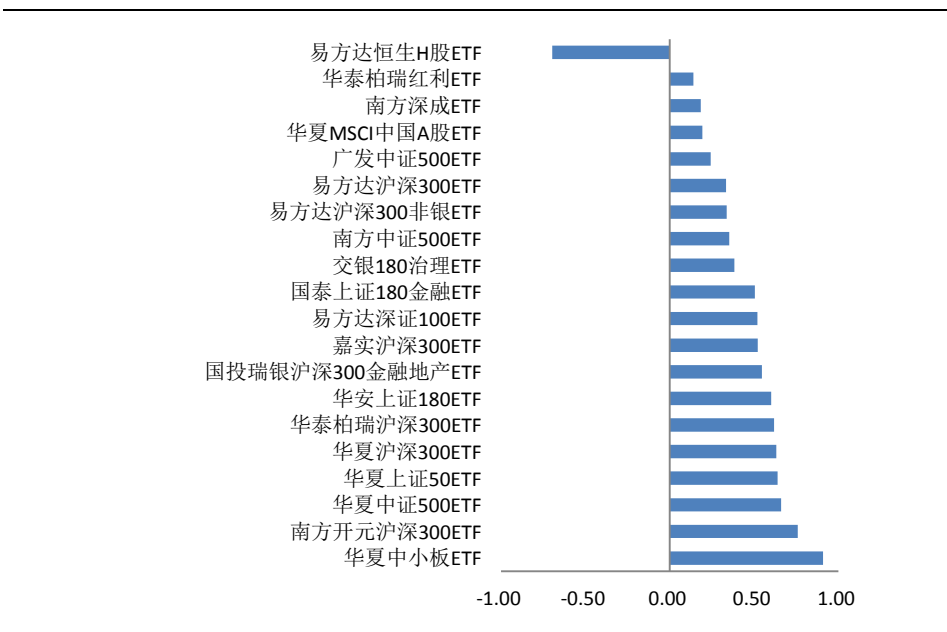


数据来源: wind、信达证券研发中心

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:华夏中小板 ETF (+0.91%)、南方开元沪深 300ETF (+0.76%) 及华夏中证 500ETF (+0.66%);跌幅前三名为:易方达恒生 H 股 ETF (-0.7%)、华泰柏瑞红利 ETF (+0.14%) 及南方深成 ETF (+0.18%)。

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:游久游戏(+10.05%)、国电南瑞(+9.99%)、二六三(+9.95%)、德豪润达(+8.04%)和美的集团(+7.12%);跌幅前五名为:盾安环境(-6.33%)、德力股份(-4.99%)、盐田港(-4.33%)、棕榈股份(-3.88%)和东方金钰(-3.55%)。

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 | 600652.SH | 游久游戏 | 10.05 | 2.23 | 002011.SZ | 盾安环境 | -6.33 | 0.69 |
| 2 | 600406.SH | 国电南瑞 | 9.99 | 0.68 | 002571.SZ | 德力股份 | -4.99 | 0.57 |
| 3 | 002467.SZ | 二六三 | 9.95 | 2.31 | 000088.SZ | 盐田港 | -4.33 | 1.07 |
| 4 | 002005.SZ | 德豪润达 | 8.04 | 0.00 | 002431.SZ | 棕榈股份 | -3.88 | 1.06 |
| 5 | 600107.SH | 美尔雅 | 7.12 | 1.52 | 600086.SH | 东方金钰 | -3.55 | 1.13 |
| 6 | 600089.SH | 特变电工 | 6.97 | 0.00 | 601021.SH | 春秋航空 | -3.44 | 1.54 |
| 7 | 600662.SH | 强生控股 | 6.76 | 6.49 | 601996.SH | 丰林集团 | -3.30 | 1.09 |
| 8 | 002299.SZ | 圣农发展 | 6.48 | 2.46 | 002482.SZ | 广田集团 | -3.23 | 2.55 |
| 9 | 600604.SH | 市北高新 | 5.83 | 2.96 | 600601.SH | 方正科技 | -3.10 | 1.72 |
| 10 | 600119.SH | 长江投资 | 5.72 | 2.99 | 000551.SZ | 创元科技 | -3.08 | 1.19 |
| 11 | 002415.SZ | 海康威视 | 5.62 | 1.76 | 002429.SZ | 兆驰股份 | -3.03 | 2.99 |
| 12 | 600031.SH | 三一重工 | 4.89 | 4.37 | 002371.SZ | 北方华创 | -2.81 | 0.91 |
| 13 | 000550.SZ | 江铃汽车 | 4.54 | 1.89 | 300226.SZ | 上海钢联 | -2.80 | 0.66 |
| 14 | 002325.SZ | 洪涛股份 | 4.49 | 3.77 | 601101.SH | 昊华能源 | -2.53 | 0.65 |
| 15 | 600483.SH | 福能股份 | 4.44 | 2.93 | 600802.SH | 福建水泥 | -2.42 | 0.87 |
| 16 | 601633.SH | 长城汽车 | 4.42 | 3.22 | 601901.SH | 方正证券 | -2.39 | 1.28 |
| 17 | 600206.SH | 有研新材 | 4.42 | 2.95 | 002307.SZ | 北新路桥 | -2.39 | 0.80 |
| 18 | 000600.SZ | 建投能源 | 4.33 | 1.74 | 601566.SH | 九牧王 | -2.39 | 1.33 |
| 19 | 002561.SZ | 徐家汇 | 3.98 | 3.65 | 600756.SH | 浪潮软件 | -2.34 | 0.68 |
| 20 | 600240.SH | 华业资本 | 3.72 | 1.51 | 002233.SZ | 塔牌集团 | -2.31 | 1.10 |

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：强生控股（6.49）、三一重工（4.37）、上海家化（4.19）、大众交通（3.9）和洪涛股份（3.77）。

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 | 600662.SH | 强生控股 | 6.76 | 6.49 |
| 2 | 600031.SH | 三一重工 | 4.89 | 4.37 |
| 3 | 600315.SH | 上海家化 | 1.24 | 4.19 |
| 4 | 600611.SH | 大众交通 | 3.16 | 3.90 |
| 5 | 002325.SZ | 洪涛股份 | 4.49 | 3.77 |
| 6 | 002561.SZ | 徐家汇 | 3.98 | 3.65 |
| 7 | 000989.SZ | 九芝堂 | 2.05 | 3.58 |
| 8 | 600626.SH | 申达股份 | 3.68 | 3.47 |
| 9 | 601633.SH | 长城汽车 | 4.42 | 3.22 |
| 10 | 600600.SH | 青岛啤酒 | 2.60 | 3.14 |
| 11 | 002024.SZ | 苏宁云商 | 1.81 | 3.11 |
| 12 | 000049.SZ | 德赛电池 | 0.33 | 3.05 |
| 13 | 002429.SZ | 兆驰股份 | -3.03 | 2.99 |
| 14 | 600119.SH | 长江投资 | 5.72 | 2.99 |
| 15 | 600604.SH | 市北高新 | 5.83 | 2.96 |
| 16 | 600206.SH | 有研新材 | 4.42 | 2.95 |

| | | | | |
|----|-----------|------|------|------|
| 17 | 600483.SH | 福能股份 | 4.44 | 2.93 |
| 18 | 600676.SH | 交运股份 | 2.80 | 2.75 |
| 19 | 600199.SH | 金种子酒 | 2.05 | 2.70 |
| 20 | 000400.SZ | 许继电气 | 3.33 | 2.66 |

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: 歌华有线(39.68%)、宁波华翔(37.1%)、华孚色纺(36.74%)、信立泰(35.96%)、普洛药业(35.03%)。

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 | 600037.SH | 歌华有线 | 1.20 | 39.68 | 32.56 |
| 2 | 002048.SZ | 宁波华翔 | 2.38 | 37.10 | 57.38 |
| 3 | 002042.SZ | 华孚色纺 | 1.34 | 36.74 | 25.70 |
| 4 | 002294.SZ | 信立泰 | 2.51 | 35.96 | 53.32 |
| 5 | 000739.SZ | 普洛药业 | 0.92 | 35.03 | 12.45 |
| 6 | 000729.SZ | 燕京啤酒 | 1.66 | 34.23 | 38.99 |
| 7 | 002308.SZ | 威创股份 | 1.05 | 33.06 | 12.41 |
| 8 | 600031.SH | 三一重工 | 4.89 | 32.80 | 243.16 |
| 9 | 000661.SZ | 长春高新 | 3.32 | 32.69 | 118.85 |
| 10 | 600600.SH | 青岛啤酒 | 2.60 | 30.96 | 87.37 |
| 11 | 000543.SZ | 皖能电力 | 0.53 | 30.59 | 15.72 |
| 12 | 000528.SZ | 柳工 | 1.12 | 29.63 | 29.95 |
| 13 | 601225.SH | 陕西煤业 | 2.94 | 29.32 | 112.26 |
| 14 | 300122.SZ | 智飞生物 | 2.19 | 29.24 | 13.99 |
| 15 | 600478.SH | 科力远 | 1.28 | 29.13 | 44.70 |
| 16 | 000777.SZ | 中核科技 | 2.32 | 28.96 | 46.92 |
| 17 | 002385.SZ | 大北农 | 0.98 | 28.89 | 16.50 |
| 18 | 000425.SZ | 徐工机械 | 2.02 | 28.72 | 72.70 |
| 19 | 600169.SH | 太原重工 | 1.08 | 27.91 | 8.84 |
| 20 | 002372.SZ | 伟星新材 | 3.31 | 27.83 | 39.81 |

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: 中国中冶(23.15%)、青岛啤酒(22.59%)、上海银行(22.15%)、华域汽车(20.02%)、山西汾酒(19.96%); 尾盘金额流入率最高的前五名是: 滨化股份(25.65%)、智飞生物(24.25%)、福能股份(23.81%)、洲际油气(23.78%)、紫鑫药业(22.89%)。

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 | 601618.SH | 中国中冶 | 1.01 | 23.15 | 71.42 | 601678.SH | 滨化股份 | 0.92 | 25.65 | 13.57 |
| 2 | 600600.SH | 青岛啤酒 | 2.60 | 22.59 | 63.78 | 300122.SZ | 智飞生物 | 2.19 | 24.25 | 12.14 |
| 3 | 601229.SH | 上海银行 | 0.32 | 22.15 | 188.66 | 600483.SH | 福能股份 | 4.44 | 23.81 | 23.17 |
| 4 | 600741.SH | 华域汽车 | 3.43 | 20.02 | 173.54 | 600759.SH | 洲际油气 | 0.97 | 23.78 | 22.77 |
| 5 | 600809.SH | 山西汾酒 | 1.60 | 19.96 | 107.27 | 002118.SZ | 紫鑫药业 | 0.15 | 22.89 | 6.46 |
| 6 | 600139.SH | 西部资源 | -0.65 | 19.57 | 34.62 | 002308.SZ | 威创股份 | 1.05 | 18.95 | 7.24 |
| 7 | 601668.SH | 中国建筑 | 2.82 | 18.68 | 668.97 | 600285.SH | 羚锐制药 | 1.51 | 16.92 | 9.08 |
| 8 | 600626.SH | 申达股份 | 3.68 | 18.62 | 19.88 | 000777.SZ | 中核科技 | 2.32 | 16.62 | 27.42 |

| | | | | | | | | | | |
|----|-----------|------|------|-------|--------|-----------|------|-------|-------|--------|
| 9 | 600566.SH | 济川药业 | 0.69 | 17.88 | 19.52 | 600551.SH | 时代出版 | 0.83 | 16.44 | 7.16 |
| 10 | 601939.SH | 建设银行 | 0.49 | 16.69 | 153.81 | 600614.SH | 鹏起科技 | -0.27 | 16.33 | 19.13 |
| 11 | 002179.SZ | 中航光电 | 1.42 | 14.75 | 19.15 | 300014.SZ | 亿纬锂能 | 2.41 | 15.70 | 32.89 |
| 12 | 600107.SH | 美尔雅 | 7.12 | 14.57 | 28.11 | 601899.SH | 紫金矿业 | 0.30 | 15.18 | 24.04 |
| 13 | 600478.SH | 科力远 | 1.28 | 13.53 | 20.76 | 600740.SH | 山西焦化 | 0.16 | 14.78 | 3.08 |
| 14 | 603993.SH | 洛阳钼业 | 0.72 | 13.46 | 25.85 | 000988.SZ | 华工科技 | 1.96 | 14.67 | 20.15 |
| 15 | 600259.SH | 广晟有色 | 1.37 | 13.42 | 13.52 | 002460.SZ | 赣锋锂业 | 2.04 | 14.47 | 118.33 |
| 16 | 601098.SH | 中南传媒 | 0.67 | 13.14 | 9.31 | 002130.SZ | 沃尔核材 | 0.31 | 14.36 | 11.37 |
| 17 | 600284.SH | 浦东建设 | 1.22 | 12.91 | 9.63 | 600366.SH | 宁波韵升 | -0.18 | 14.27 | 9.03 |
| 18 | 600315.SH | 上海家化 | 1.24 | 12.91 | 39.35 | 601515.SH | 东风股份 | 0.37 | 14.13 | 1.79 |
| 19 | 000166.SZ | 申万宏源 | 0.35 | 12.51 | 13.36 | 300205.SZ | 天喻信息 | 3.07 | 13.69 | 10.36 |
| 20 | 600642.SH | 申能股份 | 0.00 | 12.45 | 13.40 | 600859.SH | 王府井 | 3.32 | 13.52 | 11.69 |

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金刚玻璃(26.8%)、全柴动力(22.02%)、华平股份(21.98%)等, 融资余额占流通市值比例增速前十名为爱尔眼科(+16.44%)、创元科技(+12.41%)、盐田港(+11.63%)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 | 300093.SZ | 金刚玻璃 | 26.80 | 300015.SZ | 爱尔眼科 | 16.44 |
| 2 | 600218.SH | 全柴动力 | 22.02 | 000551.SZ | 创元科技 | 12.41 |
| 3 | 300074.SZ | 华平股份 | 21.98 | 000088.SZ | 盐田港 | 11.63 |
| 4 | 300077.SZ | 国民技术 | 20.39 | 600660.SH | 福耀玻璃 | 10.66 |
| 5 | 300157.SZ | 恒泰艾普 | 19.86 | 000049.SZ | 德赛电池 | 9.73 |
| 6 | 002476.SZ | 宝莫股份 | 18.52 | 601021.SH | 春秋航空 | 7.34 |
| 7 | 300128.SZ | 锦富技术 | 18.37 | 600004.SH | 白云机场 | 6.48 |
| 8 | 000790.SZ | 泰合健康 | 18.19 | 601211.SH | 国泰君安 | 6.12 |
| 9 | 000554.SZ | 泰山石油 | 18.16 | 000869.SZ | 张裕 A | 5.86 |
| 10 | 600293.SH | 三峡新材 | 18.13 | 600177.SH | 雅戈尔 | 5.31 |

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长安汽车、广发证券、东方雨虹等 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 | 000625.SZ | 长安汽车 | 13.36 | 13.96 | -4.30 | 14.07 | 119.00 | 1589.84 |
| 2 | 000776.SZ | 广发证券 | 16.32 | 16.78 | -2.74 | 16.79 | 400.00 | 6528.00 |
| 3 | 002271.SZ | 东方雨虹 | 34.30 | 35.84 | -4.30 | 35.67 | 50.00 | 1715.00 |
| 4 | 002415.SZ | 海康威视 | 31.22 | 29.56 | 5.62 | 31.22 | 600.00 | 18732.00 |
| 5 | 002557.SZ | 洽洽食品 | 14.00 | 14.12 | -0.85 | 14.00 | 74.64 | 1044.96 |
| 6 | 600017.SH | 日照港 | 4.36 | 4.38 | -0.46 | 4.37 | 615.00 | 2681.40 |
| 7 | 600089.SH | 特变电工 | 9.97 | 9.32 | 6.97 | 9.97 | 155.28 | 1548.14 |
| 8 | 600340.SH | 华夏幸福 | 35.00 | 35.14 | -0.40 | 35.93 | 40.00 | 1400.00 |

| | | | | | | | | |
|----|-----------|------|-------|-------|-------|-------|--------|---------|
| 9 | 600699.SH | 均胜电子 | 27.01 | 29.92 | -9.73 | 30.18 | 15.00 | 405.15 |
| 10 | 600999.SH | 招商证券 | 16.43 | 16.98 | -3.24 | 16.90 | 600.00 | 9858.00 |
| 11 | 601211.SH | 国泰君安 | 19.25 | 19.36 | -0.57 | 19.25 | 223.92 | 4310.48 |

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 50 只标的股票停牌，其中今日没有开始停牌股票，今日复牌股票有锦龙股份、大智慧、万科 A 等 4 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 | 000712.SZ | 锦龙股份 | 复牌 | 2017-06-09 | 3 | 0.26 | 重大事项 |
| 2 | 601519.SH | 大智慧 | 复牌 | 2017-06-08 | 4 | 0.58 | 重要事项未公告 |
| 3 | 000002.SZ | 万科 A | 复牌 | 2017-06-07 | 5 | 1.81 | 重大事项 |
| 4 | 000566.SZ | 海南海药 | 复牌 | 2017-06-05 | 7 | 1.70 | 重大事项 |
| 5 | 600018.SH | 上港集团 | 停牌 | 2017-06-08 | 4 | 0.58 | 重要事项未公告 |
| 6 | 600797.SH | 浙大网新 | 停牌 | 2017-06-08 | 4 | 0.58 | 重要事项未公告 |
| 7 | 600654.SH | 中安消 | 停牌 | 2017-06-07 | 5 | 1.81 | 重要事项未公告 |
| 8 | 600557.SH | 康缘药业 | 停牌 | 2017-06-06 | 6 | 2.16 | 重要事项未公告 |
| 9 | 600648.SH | 外高桥 | 停牌 | 2017-06-06 | 6 | 2.16 | 重要事项未公告 |
| 10 | 600795.SH | 国电电力 | 停牌 | 2017-06-05 | 7 | 1.70 | 重要事项未公告 |
| 11 | 601088.SH | 中国神华 | 停牌 | 2017-06-05 | 7 | 1.70 | 重要事项未公告 |
| 12 | 002151.SZ | 北斗星通 | 停牌 | 2017-06-01 | 11 | 1.32 | 重大事项 |
| 13 | 600193.SH | 创兴资源 | 停牌 | 2017-06-01 | 11 | 1.32 | 重大资产重组 |
| 14 | 601989.SH | 中国重工 | 停牌 | 2017-05-31 | 12 | 1.55 | 重大事项 |
| 15 | 601919.SH | 中远海控 | 停牌 | 2017-05-17 | 26 | 1.46 | 重大资产重组 |
| 16 | 600460.SH | 士兰微 | 停牌 | 2017-05-12 | 31 | 3.17 | 重大资产重组 |
| 17 | 000503.SZ | 海虹控股 | 停牌 | 2017-05-11 | 32 | 3.46 | 重大资产重组 |
| 18 | 600289.SH | 亿阳信通 | 停牌 | 2017-05-10 | 33 | 2.53 | 重要事项未公告 |
| 19 | 600653.SH | 中华控股 | 停牌 | 2017-05-08 | 35 | 1.78 | 重大资产重组 |
| 20 | 000656.SZ | 金科股份 | 停牌 | 2017-05-05 | 38 | 0.99 | 重大资产重组 |
| 21 | 000099.SZ | 中信海直 | 停牌 | 2017-05-04 | 39 | 0.74 | 重大资产重组 |
| 22 | 002070.SZ | *ST 众和 | 停牌 | 2017-05-02 | 41 | 0.12 | 实施退市风险警示 |
| 23 | 601872.SH | 招商轮船 | 停牌 | 2017-05-02 | 41 | 0.12 | 重要事项未公告 |
| 24 | 002399.SZ | 海普瑞 | 停牌 | 2017-04-28 | 45 | 0.20 | 重大事项 |
| 25 | 000887.SZ | 中鼎股份 | 停牌 | 2017-04-27 | 46 | 0.56 | 重大资产重组 |
| 26 | 600318.SH | 新力金融 | 停牌 | 2017-04-27 | 46 | 0.56 | 公司申请停牌对相关事项进行核查 |
| 27 | 000506.SZ | 中润资源 | 停牌 | 2017-04-25 | 48 | 0.92 | 重大资产重组 |
| 28 | 600568.SH | 中珠医疗 | 停牌 | 2017-04-25 | 48 | 0.92 | 重大资产重组 |
| 29 | 601717.SH | 郑煤机 | 停牌 | 2017-04-24 | 49 | -0.46 | 重大资产重组 |
| 30 | 000100.SZ | TCL 集团 | 停牌 | 2017-04-21 | 52 | -0.43 | 重大事项 |
| 31 | 002252.SZ | 上海莱士 | 停牌 | 2017-04-21 | 52 | -0.43 | 重大事项 |
| 32 | 600100.SH | 同方股份 | 停牌 | 2017-04-21 | 52 | -0.43 | 重大资产重组 |

| | | | | | | | |
|----|-----------|------|----|------------|-----|-------|-----------------|
| 33 | 300168.SZ | 万达信息 | 停牌 | 2017-04-20 | 53 | -0.39 | 重大事项 |
| 34 | 601608.SH | 中信重工 | 停牌 | 2017-04-19 | 54 | -1.20 | 重要事项未公告 |
| 35 | 300104.SZ | 乐视网 | 停牌 | 2017-04-17 | 56 | -2.70 | 重大资产重组 |
| 36 | 600643.SH | 爱建集团 | 停牌 | 2017-04-17 | 56 | -2.70 | 公司申请停牌对相关事项进行检查 |
| 37 | 002642.SZ | 荣之联 | 停牌 | 2017-04-10 | 63 | -3.90 | 重大事项 |
| 38 | 600050.SH | 中国联通 | 停牌 | 2017-04-05 | 68 | -1.99 | 重要事项未公告 |
| 39 | 600609.SH | 金杯汽车 | 停牌 | 2017-03-20 | 84 | -2.44 | 重大资产重组 |
| 40 | 002128.SZ | 露天煤业 | 停牌 | 2017-03-17 | 87 | -3.38 | 重大资产重组 |
| 41 | 600277.SH | 亿利洁能 | 停牌 | 2017-03-06 | 98 | -1.86 | 重大资产重组 |
| 42 | 600490.SH | 鹏欣资源 | 停牌 | 2017-02-21 | 111 | -2.52 | 重大资产重组 |
| 43 | 002049.SZ | 紫光国芯 | 停牌 | 2017-02-20 | 112 | -1.36 | 重大资产重组 |
| 44 | 600387.SH | 海越股份 | 停牌 | 2017-02-08 | 124 | 0.17 | 重大资产重组 |
| 45 | 600559.SH | 老白干酒 | 停牌 | 2017-01-23 | 140 | 1.13 | 重大资产重组 |
| 46 | 300315.SZ | 掌趣科技 | 停牌 | 2017-01-19 | 144 | 1.46 | 重大资产重组 |
| 47 | 600146.SH | 商赢环球 | 停牌 | 2017-01-05 | 158 | -0.01 | 重大资产重组 |
| 48 | 600485.SH | 信威集团 | 停牌 | 2016-12-26 | 168 | 1.55 | 重大资产重组 |
| 49 | 600655.SH | 豫园商城 | 停牌 | 2016-12-20 | 174 | 1.29 | 重大资产重组 |
| 50 | 300065.SZ | 海兰信 | 停牌 | 2016-12-08 | 186 | -1.98 | 重大资产重组 |
| 51 | 600673.SH | 东阳光科 | 停牌 | 2016-11-15 | 209 | -1.62 | 重大资产重组 |
| 52 | 002025.SZ | 航天电器 | 停牌 | 2016-09-12 | 273 | 2.58 | 重大资产重组 |
| 53 | 300088.SZ | 长信科技 | 停牌 | 2016-09-12 | 273 | 2.58 | 重大资产重组 |
| 54 | 002129.SZ | 中环股份 | 停牌 | 2016-04-25 | 413 | 6.73 | 重大事项 |

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华意压缩、阳光城、长园集团等 5 只, 大股东减持标的股票有长园集团等 1 只。

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 | 000404.SZ | 华意压缩 | 2017/6/10 | 2016/6/13 | 增持 | 0.02 | 0.00 | 0.06 | 7.72 | 8.04 | -1.68 |
| 2 | 000404.SZ | 华意压缩 | 2017/6/10 | 2016/6/13 | 增持 | 0.02 | 0.00 | 0.08 | 7.62 | 8.04 | -1.68 |
| 3 | 000404.SZ | 华意压缩 | 2017/6/10 | 2016/6/13 | 增持 | 0.02 | 0.00 | 0.08 | 7.62 | 8.04 | -1.68 |
| 4 | 000404.SZ | 华意压缩 | 2017/6/10 | 2016/6/8 | 增持 | 0.01 | 0.00 | 0.05 | 7.75 | 7.97 | -1.68 |
| 5 | 000671.SZ | 阳光城 | 2017/6/10 | 2017/6/9 | 增持 | 1.23 | 0.00 | 14.71 | 5.56 | 5.63 | 0.17 |
| 6 | 600525.SH | 长园集团 | 2017/6/10 | 2017/6/8 | 增持 | 1.17 | 100.00 | 7.84 | 13.83 | 13.79 | -1.16 |
| 7 | 600535.SH | 天士力 | 2017/6/10 | 2017/6/8 | 增持 | 0.05 | 0.00 | | 39.46 | | 1.21 |
| 8 | 600755.SH | 厦门国贸 | 2017/6/10 | 2017/6/8 | 增持 | 0.02 | 0.00 | 32.96 | | 8.63 | 0.12 |
| 9 | 600755.SH | 厦门国贸 | 2017/6/10 | 2017/6/7 | 增持 | 0.37 | 0.00 | 32.93 | | 8.98 | 0.12 |
| 10 | 600525.SH | 长园集团 | 2017/6/10 | 2017/6/8 | 减持 | 1.17 | 100.00 | 2.54 | 13.83 | 13.79 | -1.16 |

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 3 只标的股票涉及增发事件, 其中新华医疗等 1 只发布董事会预案,

中集集团、新潮能源等 2 只股东大会通过，没有股票涉及增发公告日，没有股票涉及增发股份上市日。

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 | 000039.SZ | 中集集团 | 2017-06-10 | 股东大会通过 | | 定向 | 16.92 | -0.65 |
| 2 | 600777.SH | 新潮能源 | 2017-06-10 | 股东大会通过 | 2.97 | 定向 | 3.54 | 0.57 |
| 3 | 600587.SH | 新华医疗 | 2017-06-10 | 董事会预案 | | 定向 | 17.24 | 0.52 |

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，共有 101 只标的股票涉及分红送转事件，其中有中成股份、鲁泰 A、广汇能源等 5 只股东大会通过，桂林三金、日照港、华夏幸福等 15 只为实施公告日，仁和药业、中集集团、申万宏源等 65 只为股权登记日，中航飞机、高鸿股份、华邦健康等 16 只为除权除息日。

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 | 002275.SZ | 桂林三金 | 2017/6/12 | 是 | 0.40 | 实施公告日 | 17.87 | 0.28 | 2.24 | |
| 2 | 600017.SH | 日照港 | 2017/6/12 | 是 | 0.01 | 实施公告日 | 4.37 | -0.23 | 0.23 | |
| 3 | 600340.SH | 华夏幸福 | 2017/6/12 | 是 | 0.66 | 实施公告日 | 35.93 | 2.25 | 1.84 | |
| 4 | 600583.SH | 海油工程 | 2017/6/12 | 是 | 0.10 | 实施公告日 | 6.51 | -0.46 | 1.54 | |
| 5 | 601668.SH | 中国建筑 | 2017/6/12 | 是 | 0.22 | 实施公告日 | 9.86 | 2.82 | 2.18 | |
| 6 | 000665.SZ | 湖北广电 | 2017/6/10 | 是 | 0.08 | 实施公告日 | 12.02 | 0.42 | 0.67 | |
| 7 | 000828.SZ | 东莞控股 | 2017/6/10 | 是 | 0.30 | 实施公告日 | 12.38 | 0.41 | 2.42 | |
| 8 | 002007.SZ | 华兰生物 | 2017/6/10 | 是 | 0.40 | 实施公告日 | 36.76 | 0.14 | 1.09 | |
| 9 | 002128.SZ | 露天煤业 | 2017/6/10 | 是 | 0.30 | 实施公告日 | 9.00 | 0.00 | 3.33 | |
| 10 | 002313.SZ | 日海通讯 | 2017/6/10 | 是 | 0.03 | 实施公告日 | 20.20 | 0.70 | 0.15 | |
| 11 | 002405.SZ | 四维图新 | 2017/6/10 | 是 | 0.04 | 实施公告日 | 17.90 | -0.89 | 0.21 | |
| 12 | 300355.SZ | 蒙草生态 | 2017/6/10 | 是 | 0.06 | 实施公告日 | 14.35 | -0.28 | 0.42 | 0.60 |
| 13 | 600007.SH | 中国国贸 | 2017/6/10 | 是 | 0.30 | 实施公告日 | 20.81 | 0.00 | 1.44 | |
| 14 | 600118.SH | 中国卫星 | 2017/6/10 | 是 | 0.11 | 实施公告日 | 27.26 | 0.00 | 0.40 | |
| 15 | 601139.SH | 深圳燃气 | 2017/6/10 | 是 | 0.11 | 实施公告日 | 8.62 | 0.23 | 1.22 | |
| 16 | 000650.SZ | 仁和药业 | 2017/6/16 | 是 | 0.10 | 股权登记日 | 5.90 | 0.00 | 1.69 | |
| 17 | 000039.SZ | 中集集团 | 2017/6/15 | 是 | | 股权登记日 | 16.92 | -0.65 | | |
| 18 | 000166.SZ | 申万宏源 | 2017/6/15 | 是 | 0.10 | 股权登记日 | 5.72 | 0.35 | 1.75 | |
| 19 | 000402.SZ | 金融街 | 2017/6/15 | 是 | 0.40 | 股权登记日 | 12.20 | 2.26 | 3.28 | |
| 20 | 000413.SZ | 东旭光电 | 2017/6/15 | 是 | 0.07 | 股权登记日 | 10.00 | -0.40 | 0.70 | |
| 21 | 000623.SZ | 吉林敖东 | 2017/6/15 | 是 | 0.30 | 股权登记日 | 29.49 | 1.76 | 1.02 | 0.30 |
| 22 | 000970.SZ | 中科三环 | 2017/6/15 | 是 | 0.10 | 股权登记日 | 12.95 | 0.86 | 0.77 | |
| 23 | 002049.SZ | 紫光国芯 | 2017/6/15 | 是 | 0.06 | 股权登记日 | 30.88 | 0.00 | 0.18 | |
| 24 | 300003.SZ | 乐普医疗 | 2017/6/15 | 是 | 0.10 | 股权登记日 | 20.48 | 2.30 | 0.48 | |
| 25 | 300027.SZ | 华谊兄弟 | 2017/6/15 | 是 | 0.03 | 股权登记日 | 8.12 | 0.37 | 0.37 | |
| 26 | 300251.SZ | 光线传媒 | 2017/6/15 | 是 | 0.04 | 股权登记日 | 8.33 | 0.36 | 0.48 | |
| 27 | 600104.SH | 上汽集团 | 2017/6/15 | 是 | 1.65 | 股权登记日 | 30.94 | 0.19 | 5.33 | |
| 28 | 600293.SH | 三峡新材 | 2017/6/15 | 是 | 0.04 | 股权登记日 | 14.86 | -0.87 | 0.27 | 0.50 |

| | | | | | | | | | | |
|----|-----------|------|-----------|---|------|-------|-------|-------|------|------|
| 29 | 600499.SH | 科达洁能 | 2017/6/15 | 是 | 0.08 | 股权登记日 | 7.65 | 0.00 | 1.05 | |
| 30 | 601018.SH | 宁波港 | 2017/6/15 | 是 | 0.07 | 股权登记日 | 5.67 | -1.05 | 1.20 | |
| 31 | 601238.SH | 广汽集团 | 2017/6/15 | 是 | 0.22 | 股权登记日 | 27.20 | 1.30 | 0.81 | |
| 32 | 601789.SH | 宁波建工 | 2017/6/15 | 是 | 0.07 | 股权登记日 | 4.91 | 0.41 | 1.43 | |
| 33 | 601888.SH | 中国国旅 | 2017/6/15 | 是 | 1.00 | 股权登记日 | 59.38 | 0.58 | 1.68 | 1.00 |
| 34 | 601985.SH | 中国核电 | 2017/6/15 | 是 | | 股权登记日 | 7.91 | 1.93 | | |
| 35 | 000725.SZ | 京东方A | 2017/6/14 | 是 | | 股权登记日 | 4.05 | 0.75 | | |
| 36 | 000848.SZ | 承德露露 | 2017/6/14 | 是 | 0.40 | 股权登记日 | 10.35 | -0.29 | 3.86 | |
| 37 | 002154.SZ | 报喜鸟 | 2017/6/14 | 是 | 0.01 | 股权登记日 | 3.76 | -0.53 | 0.25 | |
| 38 | 002244.SZ | 滨江集团 | 2017/6/14 | 是 | 0.07 | 股权登记日 | 7.23 | 0.28 | 0.94 | |
| 39 | 002673.SZ | 西部证券 | 2017/6/14 | 是 | 0.11 | 股权登记日 | 13.66 | -0.87 | 0.81 | |
| 40 | 600036.SH | 招商银行 | 2017/6/14 | 是 | 0.74 | 股权登记日 | 22.91 | 0.75 | 3.23 | |
| 41 | 600066.SH | 宇通客车 | 2017/6/14 | 是 | 1.00 | 股权登记日 | 21.67 | 0.74 | 4.61 | |
| 42 | 600158.SH | 中体产业 | 2017/6/14 | 是 | 0.02 | 股权登记日 | 15.61 | -1.82 | 0.14 | |
| 43 | 600292.SH | 远达环保 | 2017/6/14 | 是 | 0.06 | 股权登记日 | 11.65 | -1.94 | 0.52 | |
| 44 | 600416.SH | 湘电股份 | 2017/6/14 | 是 | 0.05 | 股权登记日 | 12.78 | 1.35 | 0.39 | |
| 45 | 600436.SH | 片仔癀 | 2017/6/14 | 是 | 0.27 | 股权登记日 | 56.57 | -0.04 | 0.48 | |
| 46 | 600557.SH | 康缘药业 | 2017/6/14 | 是 | 0.06 | 股权登记日 | 15.44 | 0.00 | 0.39 | |
| 47 | 600572.SH | 康恩贝 | 2017/6/14 | 是 | 0.12 | 股权登记日 | 6.83 | 1.49 | 1.76 | |
| 48 | 600895.SH | 张江高科 | 2017/6/14 | 是 | 0.15 | 股权登记日 | 16.60 | 0.55 | 0.90 | |
| 49 | 601808.SH | 中海油服 | 2017/6/14 | 是 | 0.05 | 股权登记日 | 11.43 | -1.72 | 0.44 | |
| 50 | 000488.SZ | 晨鸣纸业 | 2017/6/13 | 是 | 0.60 | 股权登记日 | 12.31 | 0.33 | 4.87 | |
| 51 | 002030.SZ | 达安基因 | 2017/6/13 | 是 | 0.05 | 股权登记日 | 19.93 | 0.86 | 0.23 | |
| 52 | 002081.SZ | 金螳螂 | 2017/6/13 | 是 | 0.15 | 股权登记日 | 10.51 | 1.35 | 1.43 | |
| 53 | 002095.SZ | 生意宝 | 2017/6/13 | 是 | 0.05 | 股权登记日 | 33.64 | -0.21 | 0.15 | |
| 54 | 002106.SZ | 莱宝高科 | 2017/6/13 | 是 | 0.10 | 股权登记日 | 10.08 | 0.60 | 0.99 | |
| 55 | 002371.SZ | 北方华创 | 2017/6/13 | 是 | 0.02 | 股权登记日 | 25.90 | -2.81 | 0.08 | |
| 56 | 300034.SZ | 钢研高纳 | 2017/6/13 | 是 | 0.06 | 股权登记日 | 15.53 | -0.89 | 0.38 | |
| 57 | 600019.SH | 宝钢股份 | 2017/6/13 | 是 | 0.21 | 股权登记日 | 6.49 | 0.00 | 3.24 | |
| 58 | 600023.SH | 浙能电力 | 2017/6/13 | 是 | 0.23 | 股权登记日 | 5.69 | 0.18 | 4.04 | |
| 59 | 600056.SH | 中国医药 | 2017/6/13 | 是 | 0.27 | 股权登记日 | 25.68 | -0.04 | 1.04 | |
| 60 | 600064.SH | 南京高科 | 2017/6/13 | 是 | 0.40 | 股权登记日 | 15.21 | 0.20 | 2.63 | |
| 61 | 600079.SH | 人福医药 | 2017/6/13 | 是 | 0.11 | 股权登记日 | 19.10 | -1.29 | 0.58 | |
| 62 | 600521.SH | 华海药业 | 2017/6/13 | 是 | 0.18 | 股权登记日 | 20.08 | -1.08 | 0.90 | |
| 63 | 600535.SH | 天士力 | 2017/6/13 | 是 | 0.56 | 股权登记日 | 40.21 | 1.21 | 1.39 | |
| 64 | 600663.SH | 陆家嘴 | 2017/6/13 | 是 | 0.39 | 股权登记日 | 23.26 | -1.86 | 1.69 | |
| 65 | 600750.SH | 江中药业 | 2017/6/13 | 是 | 0.40 | 股权登记日 | 34.91 | -0.94 | 1.15 | |
| 66 | 601166.SH | 兴业银行 | 2017/6/13 | 是 | 0.61 | 股权登记日 | 16.62 | 0.79 | 3.67 | |
| 67 | 601179.SH | 中国西电 | 2017/6/13 | 是 | 0.10 | 股权登记日 | 5.52 | 1.10 | 1.81 | |
| 68 | 000915.SZ | 山大华特 | 2017/6/12 | 是 | 0.15 | 股权登记日 | 49.28 | -1.77 | 0.30 | 0.30 |
| 69 | 002011.SZ | 盾安环境 | 2017/6/12 | 是 | 0.10 | 股权登记日 | 12.43 | -6.33 | 0.80 | |
| 70 | 002190.SZ | 成飞集成 | 2017/6/12 | 是 | 0.12 | 股权登记日 | 25.60 | 0.67 | 0.47 | |
| 71 | 002221.SZ | 东华能源 | 2017/6/12 | 是 | 0.05 | 股权登记日 | 10.84 | -2.08 | 0.46 | |
| 72 | 002304.SZ | 洋河股份 | 2017/6/12 | 是 | 2.10 | 股权登记日 | 88.92 | 1.28 | 2.36 | |
| 73 | 002396.SZ | 星网锐捷 | 2017/6/12 | 是 | 0.10 | 股权登记日 | 17.89 | -1.97 | 0.56 | |
| 74 | 002456.SZ | 欧菲光 | 2017/6/12 | 是 | 0.11 | 股权登记日 | 42.00 | 0.72 | 0.26 | 1.50 |

| | | | | | | | | | | |
|-----|-----------|------|-----------|---|------|--------|-------|-------|------|--|
| 75 | 002603.SZ | 以岭药业 | 2017/6/12 | 是 | 0.10 | 股权登记日 | 16.65 | -0.30 | 0.60 | |
| 76 | 600183.SH | 生益科技 | 2017/6/12 | 是 | 0.33 | 股权登记日 | 11.54 | 0.09 | 2.86 | |
| 77 | 600373.SH | 中文传媒 | 2017/6/12 | 是 | 0.12 | 股权登记日 | 20.97 | -0.76 | 0.57 | |
| 78 | 600389.SH | 江山股份 | 2017/6/12 | 是 | 0.05 | 股权登记日 | 15.87 | -2.22 | 0.33 | |
| 79 | 600797.SH | 浙大网新 | 2017/6/12 | 是 | 0.03 | 股权登记日 | 11.76 | 0.00 | 0.26 | |
| 80 | 601515.SH | 东风股份 | 2017/6/12 | 是 | 0.06 | 股权登记日 | 10.87 | 0.37 | 0.55 | |
| 81 | 000151.SZ | 中成股份 | 2017/6/10 | 是 | 0.30 | 股东大会通过 | 20.11 | -0.94 | 1.49 | |
| 82 | 000726.SZ | 鲁泰 A | 2017/6/10 | 是 | 0.50 | 股东大会通过 | 12.36 | 0.98 | 4.05 | |
| 83 | 600256.SH | 广汇能源 | 2017/6/10 | 是 | 0.03 | 股东大会通过 | 4.14 | -0.48 | 0.72 | |
| 84 | 601628.SH | 中国人寿 | 2017/6/10 | 是 | 0.24 | 股东大会通过 | 28.46 | -0.14 | 0.84 | |
| 85 | 601997.SH | 贵阳银行 | 2017/6/10 | 是 | 0.26 | 股东大会通过 | 15.78 | -0.38 | 1.65 | |
| 86 | 000768.SZ | 中航飞机 | 2017/6/12 | 是 | 0.05 | 除权除息日 | 17.94 | -0.33 | 0.28 | |
| 87 | 000851.SZ | 高鸿股份 | 2017/6/12 | 是 | 0.02 | 除权除息日 | 8.86 | -1.45 | 0.23 | |
| 88 | 002004.SZ | 华邦健康 | 2017/6/12 | 是 | 0.15 | 除权除息日 | 8.10 | -0.25 | 1.85 | |
| 89 | 002029.SZ | 七匹狼 | 2017/6/12 | 是 | 0.10 | 除权除息日 | 9.76 | 0.41 | 1.02 | |
| 90 | 002292.SZ | 奥飞娱乐 | 2017/6/12 | 是 | 0.04 | 除权除息日 | 15.61 | -0.45 | 0.26 | |
| 91 | 002437.SZ | 誉衡药业 | 2017/6/12 | 是 | 0.05 | 除权除息日 | 6.85 | -0.72 | 0.73 | |
| 92 | 002500.SZ | 山西证券 | 2017/6/12 | 是 | 0.09 | 除权除息日 | 9.40 | -0.11 | 0.96 | |
| 93 | 002579.SZ | 中京电子 | 2017/6/12 | 是 | 0.10 | 除权除息日 | 10.80 | 0.28 | 0.93 | |
| 94 | 002646.SZ | 青青稞酒 | 2017/6/12 | 是 | 0.17 | 除权除息日 | 17.47 | 1.33 | 0.97 | |
| 95 | 300191.SZ | 潜能恒信 | 2017/6/12 | 是 | 0.01 | 除权除息日 | 26.36 | -0.72 | 0.04 | |
| 96 | 600201.SH | 生物股份 | 2017/6/12 | 是 | 0.50 | 除权除息日 | 34.23 | -0.06 | 1.46 | |
| 97 | 600216.SH | 浙江医药 | 2017/6/12 | 是 | | 除权除息日 | 9.54 | -0.21 | | |
| 98 | 600300.SH | 维维股份 | 2017/6/12 | 是 | 0.02 | 除权除息日 | 5.76 | 0.88 | 0.35 | |
| 99 | 600458.SH | 时代新材 | 2017/6/12 | 是 | 0.10 | 除权除息日 | 11.02 | 0.82 | 0.91 | |
| 100 | 600894.SH | 广日股份 | 2017/6/12 | 是 | 0.38 | 除权除息日 | 12.00 | 0.59 | 3.17 | |

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

今日无标的股票业绩报告发布。

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 | | | | | | | |

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 个交易日共有华意压缩、温氏股份、劲嘉股份等 17 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股解禁

| 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 | 000404.SZ | 华意压缩 | 2017/6/12 | 13637.20 | 19.59 | 100 | 7.61 | -1.68 |
| 2 | 300498.SZ | 温氏股份 | 2017/6/12 | 9993.33 | 1.91 | 69.16 | 23.46 | -0.59 |
| 3 | 002191.SZ | 劲嘉股份 | 2017/6/12 | 65.88 | 0.05 | 99.76 | 9.47 | 0.11 |
| 4 | 002252.SZ | 上海莱士 | 2017/6/12 | 18720.00 | 3.77 | 88.54 | 20.27 | 0.00 |

| | | | | | | | | |
|----|-----------|------|-----------|----------|-------|-------|-------|-------|
| 5 | 002063.SZ | 远光软件 | 2017/6/12 | 27.02 | 0.04 | 88.59 | 10.58 | 0.76 |
| 6 | 300005.SZ | 探路者 | 2017/6/12 | 8000.00 | 13.46 | 72.21 | 11.80 | -1.26 |
| 7 | 000078.SZ | 海王生物 | 2017/6/12 | 1215.75 | 0.46 | 70.1 | 6.00 | 1.01 |
| 8 | 000860.SZ | 顺鑫农业 | 2017/6/13 | 757.58 | 1.33 | 100 | 19.43 | 0.94 |
| 9 | 002292.SZ | 奥飞娱乐 | 2017/6/13 | 614.70 | 0.47 | 58.07 | 15.61 | -0.45 |
| 10 | 600711.SH | 盛屯矿业 | 2017/6/15 | 4030.50 | 2.69 | 100 | 6.27 | -0.48 |
| 11 | 600998.SH | 九州通 | 2017/6/15 | 204.93 | 0.12 | 99.16 | 19.85 | -0.05 |
| 12 | 300070.SZ | 碧水源 | 2017/6/16 | 788.55 | 0.25 | 59.86 | 19.34 | 0.62 |
| 13 | 002005.SZ | 德豪润达 | 2017/6/19 | 23000.00 | 16.47 | 100 | 4.84 | 8.04 |
| 14 | 002022.SZ | 科华生物 | 2017/6/19 | 4048.91 | 7.90 | 82.06 | 17.87 | -0.17 |
| 15 | 600048.SH | 保利地产 | 2017/6/20 | 97680.11 | 8.24 | 98.97 | 9.68 | -0.62 |
| 16 | 600807.SH | 天业股份 | 2017/6/20 | 21087.24 | 23.84 | 97.6 | 9.19 | -0.33 |
| 17 | 002277.SZ | 友阿股份 | 2017/6/20 | 28436.00 | 20.07 | 100 | 6.28 | -0.48 |

数据来源: wind、信达证券研发中心

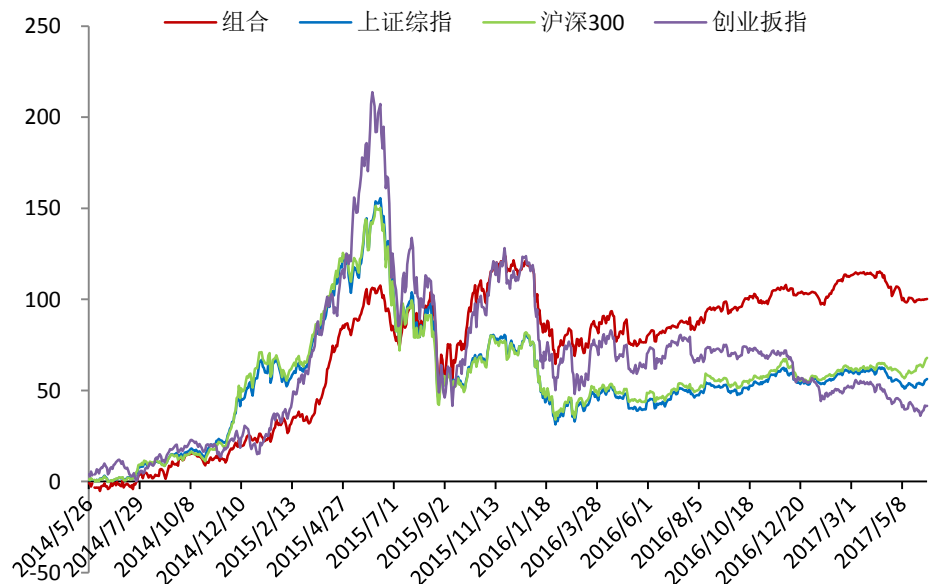
三、事件投资组合操作

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。

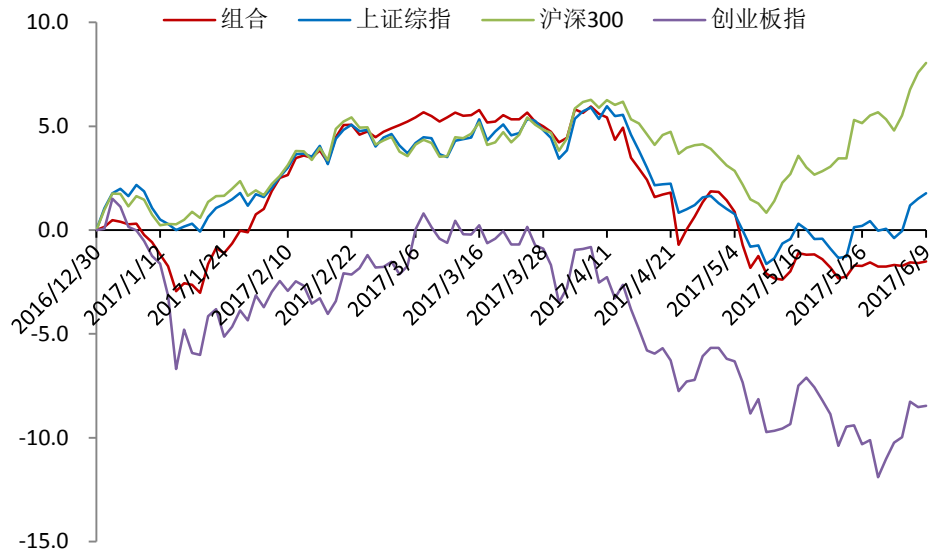
1. 组合历史收益

上一交易日组合收益率为 0.07%, 至 2017 年 6 月 9 日组合累计收益率为 100.15%, 分别超越上证综指、沪深 300 及创业板指 43.89、32.32 及 58.67 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 | 0.26 | 0.32 | -6.80 | -2.82 | 10.14 | -1.51 |
| 上证综指 | 1.80 | 1.78 | -2.33 | -1.29 | 7.97 | 1.76 |
| 沪深300 | 2.24 | 5.72 | 3.76 | 3.38 | 12.92 | 8.04 |
| 创业板指 | 3.91 | -1.21 | -8.49 | -15.37 | -17.93 | -8.46 |

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: 无。

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 | | | | | |

数据来源: wind、信达证券研发中心

2) 今日拟平仓股票

今日无拟平仓股票。

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 | | | | | |

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 2017 年 6 月 9 日收盘，组合共有成分股 3 只，仓位 9%。

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 | 002129.SZ | 中环股份 | 2016/4/1 | 8.92 | 3.00 | 8.27 | -7.33 | -12.47 |
| 2 | 002151.SZ | 北斗星通 | 2017/5/2 | 29.59 | 3.00 | 28.19 | -4.73 | -4.85 |
| 3 | 300014.SZ | 亿纬锂能 | 2017/6/8 | 15.12 | 3.00 | 15.30 | 1.19 | 0.61 |

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 | 巩婷婷 | 010-63081128 | 13811821399 | gongtingting@cindasc.com |
| 华东 | 王莉本 | 021-61678592 | 18121125183 | wangliben@cindasc.com |
| 华东 | 文襄琳 | 021-63570071 | 13681810356 | wenxianglin@cindasc.com |
| 华东 | 洪 辰 | 021-61678568 | 13818525553 | hongchen@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 |
| 国际 | 王小乐 | 010-63081122 | 18301418636 | wangxiaole@cindasc.com |