

## 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 83326757  
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27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 8765.67 亿元(+0.62%), 其中融资余额规模为 8719.17 亿元(+0.59%), 融券余额规模为 46.5 亿元(+5.7%)。从融资规模来看, 上一交易日沪深两市融资买入额为 472.53 亿元(+28.78%), 融资偿还额为 421.31 亿元(+7.9%)。
- 上一交易日, 市场指数中深证成指 (+1.65%) 表现最好, 创业板指 (+0.77%) 表现最弱; 从行业来看, 房地产 (+2.51%)、汽车 (+1.94%)、食品饮料 (+1.83%)、钢铁 (+1.77%)、电子 (+1.71%) 等行业表现较好, 银行 (+0.03%)、公用事业 (+0.52%)、家用电器 (+0.86%)、纺织服装 (+0.88%)、农林牧渔 (+0.95%) 等行业表现较弱。
- 两融标的股票中, 涨幅前五名为: 万科 A (+10.01%)、方大炭素 (+10%)、晋西车轴 (+10%)、安信信托 (+9.99%) 和威孚高科 (+9.99%); 跌幅前五名为: 建投能源 (-6.17%)、掌趣科技 (-1.92%)、沃尔核材 (-1.78%)、新华保险 (-1.59%) 和交通银行 (-1.3%); 五日量比前五名为: 美都能源 (9.94)、威孚高科 (5.55)、洽洽食品 (4.68)、中天金融 (4.3) 和中天科技 (4.16)。
- 上一交易日, 发生大宗交易的标的股票有温氏股份、掌趣科技、海康威视等 11 只。
- 今日共有 48 只标的股票停牌, 其中今日没有开始停牌股票, 今日复牌股票有陕国投 A 等 1 只。
- 今日披露, 大股东增持标的股票有阳光城、湖北能源、省广股份等 4 只, 大股东减持标的股票有光正集团等 2 只。
- 今日披露, 共有 6 只标的股票涉及增发事件, 其中陕西金叶、南方航空等 2 只发布董事会预案, 东旭光电、上海电力、新华医疗等 4 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 67 只标的股票涉及分红送转事件, 其中有同仁堂、同济科技、兴业证券等 5 只股东大会通过, 威孚高科、阳光城、广发证券等 6 只为实施公告日, 中远海能、农产品、鞍钢股份等 49 只为股权登记日, 中色股份、太钢不锈、江特电机等 7 只为除权除息日。
- 今日无标的股票业绩报告发布。
- 未来 7 个交易日共有碧水源、首开股份、爱尔眼科等 11 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: 湖北能源(股东增持)。
- 今日无拟平仓股票。
- 上一交易日组合收益率为 0.32%, 至 2017 年 6 月 26 日组合累计收益率为 102.22%, 分别超越上证综指、沪深 300 及创业板指 44.63、30.08 及 58.76 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.....	13
6. 标的股票限售股解禁.....	13
三、事件投资组合操作.....	14
1. 组合历史收益.....	14
2. 今日组合操作.....	15
3. 昨日组合操作回顾.....	15
4. 组合成分股.....	16

## 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.....	12
图表 17: 今日发布相关业绩报告的标的股票 .....	13
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.....	14
图表 20: 组合今年以来收益曲线.....	15
图表 21: 组合历史收益对比.....	15
图表 22: 今日拟建仓股票 .....	15

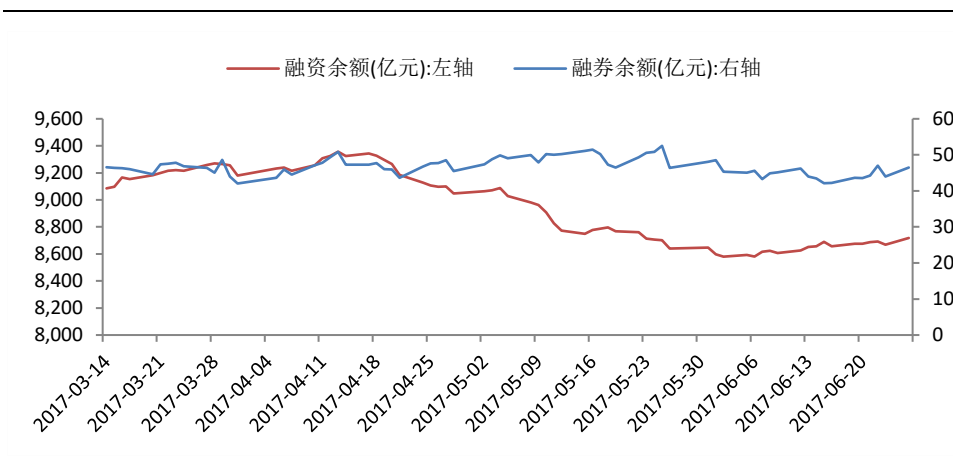
图表 23: 今日拟平仓股票.....	15
图表 24: 昨日建仓股票.....	15
图表 25: 昨日平仓股票.....	16
图表 26: 组合成分股.....	16

## 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 8765.67 亿元(+0.62%)，其中融资余额规模为 8719.17 亿元(+0.59%)，融券余额规模为 46.5 亿元(+5.7%)。

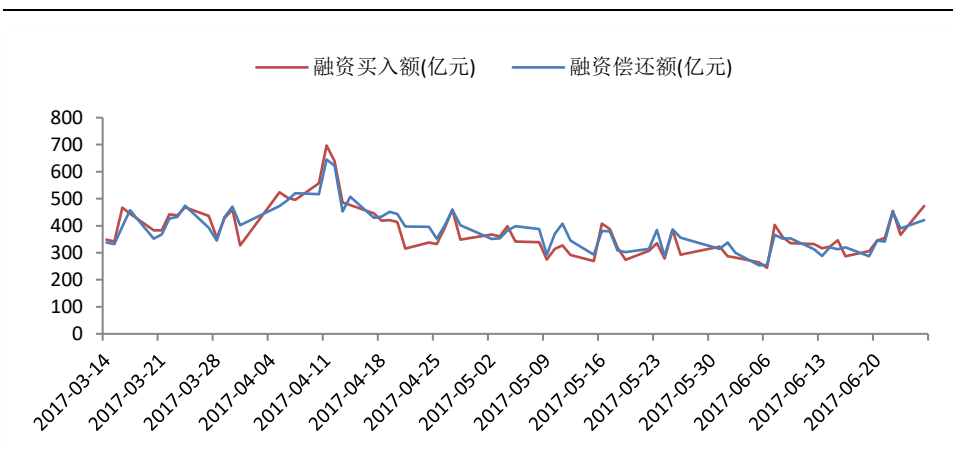
图表 1: 近三月每日融资融券余额规模 (亿元)



数据来源: wind, 信达证券研发中心

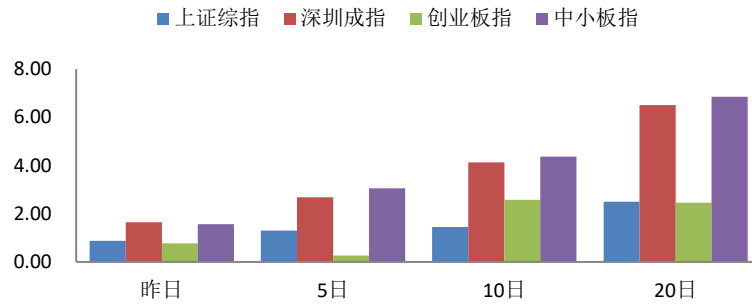
从融资规模来看，上一交易日沪深两市融资买入额为 472.53 亿元(+28.78%)，融资偿还额为 421.31 亿元(+7.9%)。

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，市场指数中深证成指表现较好，上涨 1.65%，创业板指表现最弱，上涨 0.77%；从 5 日涨跌幅看，中小板指表现较好，上涨 3.06%，创业板指表现最弱，上涨 0.27%；从 10 日涨跌幅看，中小板指表现较好，上涨 4.37%，上证综指表现最弱，上涨 1.45%；从 20 日涨跌幅看，中小板指表现较好，上涨 6.86%，创业板指表现最弱，上涨 2.45%。

**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,银行(+1.24%)、非银金融(+0.53%)、家用电器(+0.4%)等行业增速居前,房地产(-2.01%)、综合(-2.11%)、食品饮料(-2.21%)等行业增速靠后。

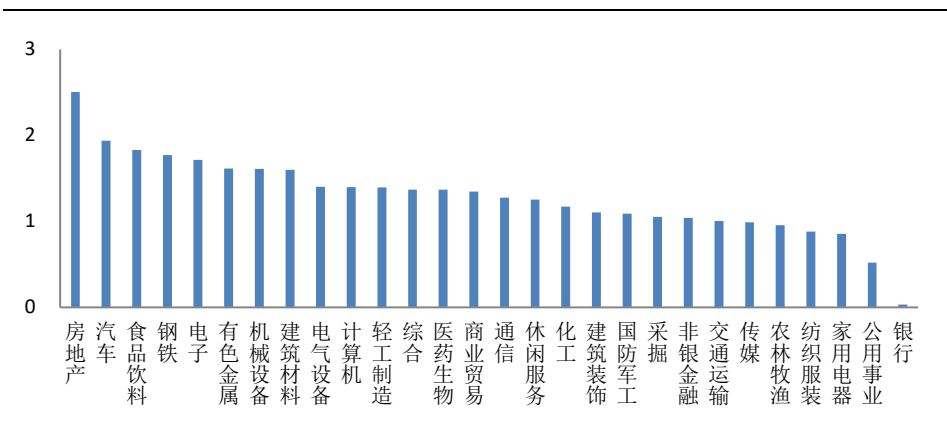
**图表 4: 上一交易日两融标的股票分行业融资余额占流通市值比例及增速(%)**

序号	代码	行业	融资余额占流通市值比例(%)	占比增速(%)
1	801780.SI	银行	0.88	1.24
2	801790.SI	非银金融	2.37	0.53
3	801110.SI	家用电器	1.91	0.40
4	801160.SI	公用事业	2.68	0.38
5	801720.SI	建筑装饰	2.39	0.13
6	801030.SI	化工	2.98	-0.07
7	801020.SI	采掘	0.82	-0.34
8	801010.SI	农林牧渔	3.40	-0.49
9	801770.SI	通信	4.72	-0.65
10	801170.SI	交通运输	2.10	-0.66
11	801880.SI	汽车	2.45	-0.76
12	801050.SI	有色金属	5.46	-0.91
13	801740.SI	国防军工	4.12	-0.93
14	801130.SI	纺织服装	3.22	-1.10
15	801710.SI	建筑材料	4.78	-1.16
16	801140.SI	轻工制造	6.28	-1.17
17	801150.SI	医药生物	2.90	-1.29
18	801750.SI	计算机	5.50	-1.35
19	801200.SI	商业贸易	5.17	-1.41
20	801760.SI	传媒	6.59	-1.46
21	801080.SI	电子	4.92	-1.48
22	801730.SI	电气设备	3.92	-1.78
23	801210.SI	休闲服务	2.19	-1.82
24	801890.SI	机械设备	3.69	-1.86
25	801040.SI	钢铁	2.47	-1.99
26	801180.SI	房地产	3.52	-2.01
27	801230.SI	综合	8.31	-2.11
28	801120.SI	食品饮料	1.20	-2.21

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,房地产(+2.51%)、汽车(+1.94%)、食品饮料(+1.83%)、钢铁(+1.77%)、电子(+1.71%)等行业表现较好,银行(+0.03%)、公用事业(+0.52%)、家用电器(+0.86%)、纺织服装(+0.88%)、农林牧渔(+0.95%)等行业表现较弱。

图表 5: 申万行业上一交易日涨跌幅(%)

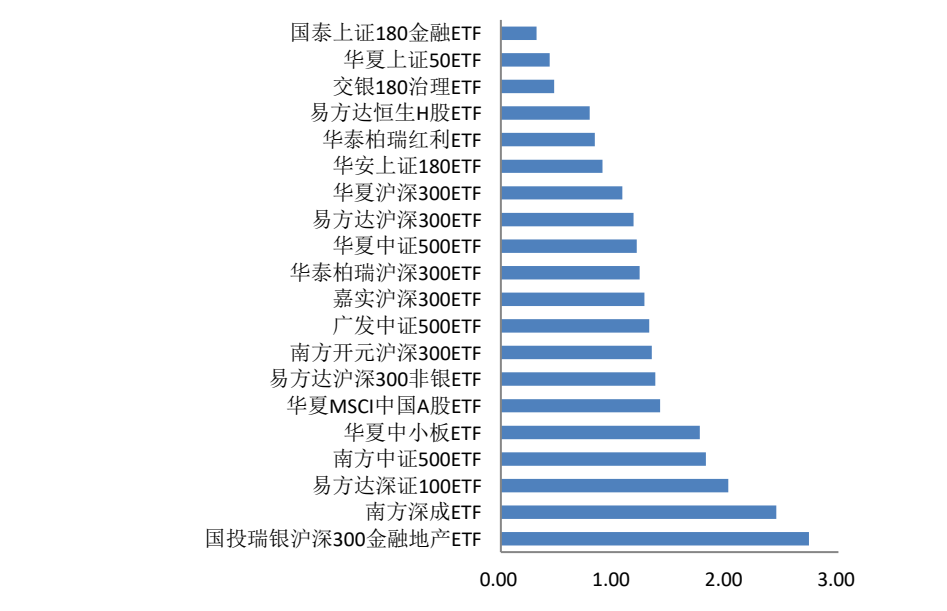


数据来源: wind、信达证券研发中心

### 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:国投瑞银沪深 300 金融地产 ETF(+2.74%)、南方深成 ETF(+2.45%)及易方达深证 100ETF(+2.02%);跌幅前三名为:国泰上证 180 金融 ETF(+0.32%)、华夏上证 50ETF(+0.43%)及交银 180 治理 ETF(+0.47%)。

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:万科A(+10.01%)、方大炭素(+10%)、晋西车轴(+10%)、安信信托(+9.99%)和威孚高科(+9.99%);跌幅前五名为:建投能源(-6.17%)、掌趣科技(-1.92%)、沃尔核材(-1.78%)、新华保险(-1.59%)

和交通银行 (-1.3%)。

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	000002.SZ	万科 A	10.01	3.40	000600.SZ	建投能源	-6.17	1.45
2	600516.SH	方大炭素	10.00	2.10	300315.SZ	掌趣科技	-1.92	0.44
3	600495.SH	晋西车轴	10.00	1.59	002130.SZ	沃尔核材	-1.78	2.16
4	600816.SH	安信信托	9.99	2.49	601336.SH	新华保险	-1.59	1.50
5	000581.SZ	威孚高科	9.99	5.55	601328.SH	交通银行	-1.30	2.45
6	300128.SZ	锦富技术	9.99	3.33	600009.SH	上海机场	-1.13	0.87
7	600175.SH	美都能源	9.93	9.94	601628.SH	中国人寿	-1.12	1.35
8	002230.SZ	科大讯飞	8.21	2.55	002508.SZ	老板电器	-1.05	1.72
9	002158.SZ	汉钟精机	7.94	1.29	600027.SH	华电国际	-0.82	1.50
10	002460.SZ	赣锋锂业	7.44	1.77	600886.SH	国投电力	-0.75	1.89
11	000488.SZ	晨鸣纸业	7.38	2.56	600741.SH	华域汽车	-0.73	1.19
12	600503.SH	华丽家族	7.22	3.88	002475.SZ	立讯精密	-0.73	1.04
13	600031.SH	三一重工	7.11	2.51	600107.SH	美尔雅	-0.73	0.51
14	000413.SZ	东旭光电	6.95	3.15	601800.SH	中国交建	-0.72	2.00
15	601002.SH	晋亿实业	6.49	2.75	600158.SH	中体产业	-0.70	0.94
16	002325.SZ	洪涛股份	6.47	3.64	000418.SZ	小天鹅 A	-0.69	1.78
17	000528.SZ	柳工	6.42	3.14	002439.SZ	启明星辰	-0.69	1.02
18	600406.SH	国电南瑞	6.17	1.86	000401.SZ	冀东水泥	-0.65	0.92
19	000039.SZ	中集集团	6.07	2.72	601398.SH	工商银行	-0.58	1.52
20	002271.SZ	东方雨虹	6.04	2.27	600639.SH	浦东金桥	-0.54	0.58

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: 美都能源 (9.94)、威孚高科 (5.55)、洽洽食品 (4.68)、中天金融 (4.3) 和中天科技 (4.16)。

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	600175.SH	美都能源	9.93	9.94
2	000581.SZ	威孚高科	9.99	5.55
3	002557.SZ	洽洽食品	4.30	4.68
4	000540.SZ	中天金融	3.73	4.30
5	600522.SH	中天科技	3.64	4.16
6	600383.SH	金地集团	4.63	3.95
7	600503.SH	华丽家族	7.22	3.88
8	601877.SH	正泰电器	5.51	3.71
9	002325.SZ	洪涛股份	6.47	3.64
10	000960.SZ	锡业股份	5.25	3.55
11	600389.SH	江山股份	5.79	3.54
12	600169.SH	太原重工	4.44	3.54
13	000002.SZ	万科 A	10.01	3.40
14	300128.SZ	锦富技术	9.99	3.33

15	002007.SZ	华兰生物	3.97	3.31
16	000413.SZ	东旭光电	6.95	3.15
17	000528.SZ	柳工	6.42	3.14
18	600458.SH	时代新材	5.38	3.11
19	600048.SH	保利地产	2.50	3.11
20	002092.SZ	中泰化学	3.93	3.09

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: 洽洽食品(56.77%)、燕京啤酒(50.91%)、众生药业(47.36%)、本钢板材(47.28%)、城市传媒(46.99%)。

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	002557.SZ	洽洽食品	4.30	56.77	37.77
2	000729.SZ	燕京啤酒	1.99	50.91	41.08
3	002317.SZ	众生药业	3.14	47.36	39.43
4	000761.SZ	本钢板材	2.02	47.28	17.18
5	600229.SH	城市传媒	2.30	46.99	11.70
6	600007.SH	中国国贸	2.22	46.56	8.01
7	600642.SH	中能股份	1.13	44.28	25.01
8	002261.SZ	拓维信息	1.27	43.95	81.29
9	002106.SZ	莱宝高科	4.41	43.55	68.71
10	002093.SZ	国脉科技	1.49	42.72	13.98
11	600288.SH	大恒科技	2.12	41.91	23.39
12	000552.SZ	靖远煤电	1.75	41.56	16.96
13	600019.SH	宝钢股份	2.01	40.62	252.52
14	002285.SZ	世联行	3.13	40.49	37.84
15	600143.SH	金发科技	1.92	40.14	60.41
16	601515.SH	东风股份	0.91	40.08	6.54
17	600790.SH	轻纺城	1.29	39.40	32.42
18	000789.SZ	万年青	2.43	38.53	23.81
19	000012.SZ	南玻 A	3.29	38.44	71.51
20	600307.SH	酒钢宏兴	2.16	37.51	68.58

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: 轻纺城(38.44%)、东风股份(30.15%)、中国高科(25.92%)、中联重科(25.86%)、宁沪高速(24.66%); 尾盘金额流入率最高的前五名是: 澄星股份(23.01%)、中航资本(20.02%)、本钢板材(19.84%)、承德露露(18.75%)、光迅科技(18.63%)。

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	600790.SH	轻纺城	1.29	38.44	32.42	600078.SH	澄星股份	3.38	23.01	11.96
2	601515.SH	东风股份	0.91	30.15	4.93	600705.SH	中航资本	2.48	20.02	48.82
3	600730.SH	中国高科	1.93	25.92	10.59	000761.SZ	本钢板材	2.02	19.84	7.44
4	000157.SZ	中联重科	2.49	25.86	84.52	000848.SZ	承德露露	1.22	18.75	15.98
5	600377.SH	宁沪高速	1.24	24.66	19.72	002281.SZ	光迅科技	4.16	18.63	55.11
6	601633.SH	长城汽车	1.92	24.35	75.29	600971.SH	恒源煤电	2.33	18.39	27.83

7	601126.SH	四方股份	3.95	23.80	15.27	002093.SZ	国脉科技	1.49	17.61	5.98
8	600844.SH	丹化科技	0.15	23.40	1.69	601018.SH	宁波港	1.44	17.55	24.23
9	600061.SH	国投安信	1.50	20.65	42.26	600222.SH	太龙药业	1.31	16.44	3.21
10	601009.SH	南京银行	1.47	19.77	128.46	600395.SH	盘江股份	1.72	16.38	10.63
11	600252.SH	中恒集团	0.50	19.75	11.51	600307.SH	酒钢宏兴	2.16	16.25	29.71
12	600711.SH	盛屯矿业	2.02	19.54	23.26	002106.SZ	莱宝高科	4.41	16.21	26.34
13	600528.SH	中铁工业	2.93	18.63	77.30	600033.SH	福建高速	2.05	16.03	18.55
14	000425.SZ	徐工机械	4.51	17.74	81.60	000422.SZ	湖北宜化	2.45	15.68	19.40
15	600807.SH	天业股份	1.34	17.41	18.33	000930.SZ	中粮生化	2.47	15.17	19.87
16	601179.SH	中国西电	1.84	16.92	12.14	600380.SH	健康元	1.71	15.13	12.85
17	601880.SH	大连港	1.01	16.88	16.25	002372.SZ	伟星新材	2.68	14.75	15.86
18	601939.SH	建设银行	-0.16	16.68	193.75	600777.SH	新潮能源	3.53	14.71	19.46
19	002261.SZ	拓维信息	1.27	16.26	30.44	600199.SH	金种子酒	2.17	14.69	5.59
20	600288.SH	大恒科技	2.12	15.97	8.91	600499.SH	科达洁能	1.32	14.25	8.24

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(27.02%)、全柴动力(21.11%)、国民技术(20.19%)等, 融资余额占流通市值比例增速前十名是深高速(+17.57%)、新华保险(+16.14%)、小天鹅 A(+13.94%)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	27.02	600548.SH	深高速	17.57
2	600218.SH	全柴动力	21.11	601336.SH	新华保险	16.14
3	300077.SZ	国民技术	20.19	000418.SZ	小天鹅 A	13.94
4	300157.SZ	恒泰艾普	20.10	002508.SZ	老板电器	11.75
5	300074.SZ	华平股份	20.05	000581.SZ	威孚高科	11.25
6	002148.SZ	北纬通信	19.64	601328.SH	交通银行	10.68
7	002369.SZ	卓翼科技	18.67	300115.SZ	长盈精密	10.45
8	000790.SZ	泰合健康	18.28	000921.SZ	海信科龙	9.91
9	600692.SH	亚通股份	18.08	002130.SZ	沃尔核材	9.74
10	000554.SZ	泰山石油	17.62	600009.SH	上海机场	8.41

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温氏股份、掌趣科技、海康威视等 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	300498.SZ	温氏股份	21.29	23.66	-10.02	23.73	30.00	638.70
2	300315.SZ	掌趣科技	7.96	8.84	-9.95	8.67	2604.62	20732.79
3	002415.SZ	海康威视	32.03	31.70	1.04	32.03	6.38	204.35
4	600435.SH	北方导航	14.19	14.11	0.57	14.19	443.97	6300.00
5	600030.SH	中信证券	17.26	16.94	1.89	17.26	12.00	207.12
6	600009.SH	上海机场	40.10	38.22	4.92	37.79	5.00	200.50

7	000858.SZ	五粮液	55.00	55.00	0.00	56.74	46.00	2530.00
8	000002.SZ	万科 A	26.48	24.07	10.01	26.48	11.47	303.73
9	002310.SZ	东方园林	16.20	17.06	-5.04	17.45	1300.00	21060.00
10	002092.SZ	中泰化学	10.54	11.71	-9.99	12.17	43.43	457.75
11	002056.SZ	横店东磁	7.63	7.63	0.00	7.63	45.00	343.35

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 48 只标的股票停牌, 其中今日没有开始停牌股票, 今日复牌股票有陕国投 A 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	000563.SZ	陕国投 A	复牌	2017-06-20	7	1.31	重大事项
2	600239.SH	云南城投	停牌	2017-06-26	1	0.87	重要事项未公告
3	002681.SZ	奋达科技	停牌	2017-06-22	5	0.93	重大事项
4	600545.SH	新疆城建	停牌	2017-06-22	5	0.93	重要事项未公告
5	601001.SH	大同煤业	停牌	2017-06-22	5	0.93	重要事项未公告
6	601727.SH	上海电气	停牌	2017-06-22	5	0.93	重要公告
7	600654.SH	中安消	停牌	2017-06-07	20	2.69	重大资产重组
8	600795.SH	国电电力	停牌	2017-06-05	22	2.57	重大资产重组
9	601088.SH	中国神华	停牌	2017-06-05	22	2.57	重要事项未公告
10	600193.SH	创兴资源	停牌	2017-06-01	26	2.19	重大资产重组
11	601989.SH	中国重工	停牌	2017-05-31	27	2.42	重大资产重组
12	601919.SH	中远海控	停牌	2017-05-17	41	2.33	重大资产重组
13	600460.SH	士兰微	停牌	2017-05-12	46	4.05	重大资产重组
14	000503.SZ	海虹控股	停牌	2017-05-11	47	4.35	重大资产重组
15	600289.SH	亿阳信通	停牌	2017-05-10	48	3.41	重要事项未公告
16	600653.SH	中华控股	停牌	2017-05-08	50	2.66	重大资产重组
17	000656.SZ	金科股份	停牌	2017-05-05	53	1.86	重大资产重组
18	000099.SZ	中信海直	停牌	2017-05-04	54	1.60	重大资产重组
19	002070.SZ	*ST 众和	停牌	2017-05-02	56	0.98	重大资产重组
20	601872.SH	招商轮船	停牌	2017-05-02	56	0.98	重要事项未公告
21	002399.SZ	海普瑞	停牌	2017-04-28	60	1.06	重大事项
22	000887.SZ	中鼎股份	停牌	2017-04-27	61	1.42	重大资产重组
23	600318.SH	新力金融	停牌	2017-04-27	61	1.42	公司申请停牌对相关事项进行核查
24	000506.SZ	中润资源	停牌	2017-04-25	63	1.79	重大资产重组
25	600568.SH	中珠医疗	停牌	2017-04-25	63	1.79	重大资产重组
26	601717.SH	郑煤机	停牌	2017-04-24	64	0.39	重大资产重组
27	000100.SZ	TCL 集团	停牌	2017-04-21	67	0.42	重大事项
28	002252.SZ	上海莱士	停牌	2017-04-21	67	0.42	重大事项
29	600100.SH	同方股份	停牌	2017-04-21	67	0.42	重大资产重组
30	300168.SZ	万达信息	停牌	2017-04-20	68	0.47	重大事项

31	601608.SH	中信重工	停牌	2017-04-19	69	-0.35	重要事项未公告
32	300104.SZ	乐视网	停牌	2017-04-17	71	-1.87	重大资产重组
33	600643.SH	爱建集团	停牌	2017-04-17	71	-1.87	重大资产重组
34	002642.SZ	荣之联	停牌	2017-04-10	78	-3.08	重大事项
35	600050.SH	中国联通	停牌	2017-04-05	83	-1.15	重要事项未公告
36	600609.SH	金杯汽车	停牌	2017-03-20	99	-1.61	重大资产重组
37	002128.SZ	露天煤业	停牌	2017-03-17	102	-2.55	重大资产重组
38	600277.SH	亿利洁能	停牌	2017-03-06	113	-1.02	重大资产重组
39	600490.SH	鹏欣资源	停牌	2017-02-21	126	-1.68	重大资产重组
40	002049.SZ	紫光国芯	停牌	2017-02-20	127	-0.52	重大资产重组
41	600559.SH	老白干酒	停牌	2017-01-23	155	1.99	重大资产重组
42	600146.SH	商赢环球	停牌	2017-01-05	173	0.84	重大资产重组
43	600485.SH	信威集团	停牌	2016-12-26	183	2.42	重大资产重组
44	600655.SH	豫园商城	停牌	2016-12-20	189	2.16	重大资产重组
45	300065.SZ	海兰信	停牌	2016-12-08	201	-1.14	重大资产重组
46	600673.SH	东阳光科	停牌	2016-11-15	224	-0.78	重大资产重组
47	002025.SZ	航天电器	停牌	2016-09-12	288	3.46	重大资产重组
48	300088.SZ	长信科技	停牌	2016-09-12	288	3.46	重大资产重组
49	002129.SZ	中环股份	停牌	2016-04-25	428	7.64	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阳光城、湖北能源、省广股份等 4 只, 大股东减持标的股票有光正集团等 2 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 (%)	交易平均价	变动期间股票均价	前涨跌幅 (%)
1	000671.SZ	阳光城	2017/6/27	2017/6/23	增持	0.76	0.00	15.32	5.80	5.72	-0.34
2	000883.SZ	湖北能源	2017/6/27	2017/6/26	增持	1.22	0.00	2.26	4.78	4.80	0.20
3	002400.SZ	省广股份	2017/6/27	2017/6/26	增持	0.04	0.00	15.30	7.84	7.81	1.94
4	002482.SZ	广田集团	2017/6/27	2017/6/23	增持	0.69	0.00	39.71		8.80	1.45
5	002524.SZ	光正集团	2017/6/27	2017/6/26	减持	0.30	0.00	30.50		9.42	2.49
6	300315.SZ	掌趣科技	2017/6/27	2017/6/26	减持	1.35	100.00	15.05	7.96	8.68	-1.92

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 6 只标的股票涉及增发事件, 其中陕西金叶、南方航空等 2 只发布董事会预案, 东旭光电、上海电力、新华医疗等 4 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	000413.SZ	东旭光电	2017-06-27	股东大会通过	9.90	定向	11.24	6.95
2	600021.SH	上海电力	2017-06-27	股东大会通过		定向	12.33	0.00
3	600587.SH	新华医疗	2017-06-27	股东大会通过		定向	16.72	0.84

4	600595.SH	中孚实业	2017-06-27	股东大会通过	5.69	定向	4.72	1.07
5	000812.SZ	陕西金叶	2017-06-27	董事会预案	7.58	定向	8.39	0.72
6	600029.SH	南方航空	2017-06-27	董事会预案		定向	9.05	2.14

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 67 只标的股票涉及分红送转事件, 其中有同仁堂、同济科技、兴业证券等 5 只股东大会通过, 威孚高科、阳光城、广发证券等 6 只为实施公告日, 中远海能、农产品、鞍钢股份等 49 只为股权登记日, 中色股份、太钢不锈、江特电机等 7 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	000581.SZ	威孚高科	2017/6/27	是	0.60	实施公告日	26.86	9.99	2.23	
2	000671.SZ	阳光城	2017/6/27	是	0.05	实施公告日	5.86	-0.34	0.85	
3	000776.SZ	广发证券	2017/6/27	是	0.35	实施公告日	17.35	1.88	2.02	
4	002444.SZ	巨星科技	2017/6/27	是	0.10	实施公告日	15.52	2.51	0.64	
5	600020.SH	中原高速	2017/6/27	是	0.09	实施公告日	4.98	1.22	1.77	
6	600094.SH	大名城	2017/6/27	是	0.05	实施公告日	7.73	0.39	0.65	
7	600026.SH	中远海能	2017/6/30	是	0.19	股权登记日	6.56	2.66	2.90	
8	000061.SZ	农产品	2017/6/29	是	0.05	股权登记日	8.93	2.53	0.56	
9	000898.SZ	鞍钢股份	2017/6/29	是	0.07	股权登记日	5.54	2.97	1.21	
10	002152.SZ	广电运通	2017/6/29	是	0.10	股权登记日	12.59	1.70	0.79	0.50
11	002311.SZ	海大集团	2017/6/29	是	0.30	股权登记日	17.85	2.00	1.68	
12	600011.SH	华能国际	2017/6/29	是	0.29	股权登记日	7.73	-0.26	3.75	
13	600132.SH	重庆啤酒	2017/6/29	是	0.80	股权登记日	24.24	1.81	3.30	
14	600500.SH	中化国际	2017/6/29	是	0.09	股权登记日	9.35	1.08	0.96	
15	600549.SH	厦门钨业	2017/6/29	是	0.20	股权登记日	21.77	3.32	0.92	
16	600802.SH	福建水泥	2017/6/29	是	0.01	股权登记日	8.64	1.05	0.13	
17	600805.SH	悦达投资	2017/6/29	是	0.10	股权登记日	7.52	1.76	1.33	
18	601311.SH	骆驼股份	2017/6/29	是	0.06	股权登记日	14.21	1.50	0.43	
19	601800.SH	中国交建	2017/6/29	是	0.19	股权登记日	15.18	-0.72	1.28	
20	601939.SH	建设银行	2017/6/29	是	0.28	股权登记日	6.31	-0.16	4.41	
21	000027.SZ	深圳能源	2017/6/28	是	0.15	股权登记日	6.94	1.61	2.16	
22	000596.SZ	古井贡酒	2017/6/28	是	0.60	股权登记日	52.40	4.11	1.15	
23	000789.SZ	万年青	2017/6/28	是	0.20	股权登记日	7.17	2.43	2.79	
24	002022.SZ	科华生物	2017/6/28	是	0.14	股权登记日	17.42	0.58	0.77	
25	002146.SZ	荣盛发展	2017/6/28	是	0.40	股权登记日	10.55	1.74	3.79	
26	002344.SZ	海宁皮城	2017/6/28	是	0.05	股权登记日	8.39	1.08	0.60	
27	002440.SZ	闰土股份	2017/6/28	是	0.35	股权登记日	15.35	1.99	2.28	
28	300055.SZ	万邦达	2017/6/28	是	0.02	股权登记日	18.63	0.38	0.08	
29	300274.SZ	阳光电源	2017/6/28	是	0.05	股权登记日	10.78	0.19	0.45	
30	600015.SH	华夏银行	2017/6/28	是	0.18	股权登记日	10.99	-0.27	1.65	0.20
31	600116.SH	三峡水利	2017/6/28	是	0.07	股权登记日	10.83	0.93	0.65	
32	600200.SH	江苏吴中	2017/6/28	是	0.03	股权登记日	13.40	0.90	0.22	

33	600517.SH	置信电气	2017/6/28	是	0.15	股权登记日	7.77	1.44	1.93	
34	600518.SH	康美药业	2017/6/28	是	0.21	股权登记日	21.91	0.74	0.94	
35	600592.SH	龙溪股份	2017/6/28	是	0.10	股权登记日	10.50	1.16	0.95	
36	600626.SH	申达股份	2017/6/28	是	0.10	股权登记日	9.59	0.63	1.04	
37	600694.SH	大商股份	2017/6/28	是	0.72	股权登记日	39.98	1.37	1.80	
38	600718.SH	东软集团	2017/6/28	是	0.10	股权登记日	15.39	0.92	0.65	
39	600851.SH	海欣股份	2017/6/28	是	0.02	股权登记日	8.83	-0.45	0.26	
40	601006.SH	大秦铁路	2017/6/28	是	0.25	股权登记日	8.29	0.24	3.02	
41	601588.SH	北辰实业	2017/6/28	是	0.06	股权登记日	6.35	2.42	0.94	
42	601699.SH	潞安环能	2017/6/28	是	0.09	股权登记日	7.84	2.22	1.15	
43	000030.SZ	富奥股份	2017/6/27	是	0.20	股权登记日	9.14	3.86	2.19	
44	000539.SZ	粤电力A	2017/6/27	是	0.08	股权登记日	5.37	0.94	1.49	
45	000543.SZ	皖能电力	2017/6/27	是	0.05	股权登记日	5.84	0.86	0.86	
46	002025.SZ	航天电器	2017/6/27	是	0.25	股权登记日	25.20	0.00	0.99	
47	002078.SZ	太阳纸业	2017/6/27	是	0.05	股权登记日	7.34	4.41	0.68	
48	002399.SZ	海普瑞	2017/6/27	是	0.25	股权登记日	20.48	0.00	1.22	
49	600033.SH	福建高速	2017/6/27	是	0.15	股权登记日	3.99	2.05	3.76	
50	600098.SH	广州发展	2017/6/27	是	0.10	股权登记日	7.58	1.47	1.32	
51	600108.SH	亚盛集团	2017/6/27	是	0.00	股权登记日	4.25	0.71	0.09	
52	600667.SH	太极实业	2017/6/27	是	0.04	股权登记日	7.21	0.14	0.55	
53	600737.SH	中粮糖业	2017/6/27	是	0.13	股权登记日	9.62	2.56	1.35	
54	601199.SH	江南水务	2017/6/27	是	0.11	股权登记日	6.98	1.60	1.58	
55	603169.SH	兰石重装	2017/6/27	是	0.01	股权登记日	12.13	0.66	0.08	
56	600085.SH	同仁堂	2017/6/27	是		股东大会通过	35.19	0.11		
57	600846.SH	同济科技	2017/6/27	是		股东大会通过	8.01	1.91		
58	601377.SH	兴业证券	2017/6/27	是		股东大会通过	7.56	1.07		
59	601618.SH	中国中冶	2017/6/27	是		股东大会通过	4.98	0.61		
60	601898.SH	中煤能源	2017/6/27	是		股东大会通过	5.80	2.11		
61	000758.SZ	中色股份	2017/6/27	是	0.02	除权除息日	6.99	1.75	0.29	
62	000825.SZ	太钢不锈	2017/6/27	是	0.02	除权除息日	4.33	2.85	0.46	
63	002176.SZ	江特电机	2017/6/27	是	0.01	除权除息日	9.03	0.67	0.16	
64	300079.SZ	数码视讯	2017/6/27	是	0.03	除权除息日	5.87	1.38	0.51	
65	600251.SH	冠农股份	2017/6/27	是	0.02	除权除息日	7.85	2.48	0.19	
66	600418.SH	江淮汽车	2017/6/27	是	0.19	除权除息日	10.55	1.25	1.80	
67	600765.SH	中航重机	2017/6/27	是	0.04	除权除息日	14.01	1.74	0.29	

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 个交易日共有碧水源、首开股份、爱尔眼科等 11 只标的股票涉及限售股解

禁。

图表 18: 未来七个交易目标的股票限售解禁

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	300070.SZ	碧水源	2017/6/28	4532.25	1.45	61.30205438	18.69	0.70
2	600376.SH	首开股份	2017/6/28	30379.75	11.78	98.69143554	11.54	2.12
3	300015.SZ	爱尔眼科	2017/6/29	956.86	0.63	78.57405867	22.72	0.09
4	601258.SH	鹿大集团	2017/6/30	5836.50	0.87	97.95967239	2.89	0.35
5	600575.SH	皖江物流	2017/6/30	26296.73	6.73	69.04266153	4.27	0.71
6	002181.SZ	粤传媒	2017/7/3	2019.30	1.74	100	5.43	0.74
7	603369.SH	今世缘	2017/7/3	57375.00	45.74	100	12.85	2.23
8	600998.SH	九州通	2017/7/3	1465.03	0.86	97.05830048	20.85	4.56
9	600893.SH	中航动力	2017/7/3	58022.57	29.77	99.94908449	28.00	3.02
10	600380.SH	健康元	2017/7/3	1036.30	0.65	99.16053918	8.93	1.71
11	600115.SH	东方航空	2017/7/3	132740.68	9.18	67.79628542	6.92	0.73

数据来源: wind、信达证券研发中心

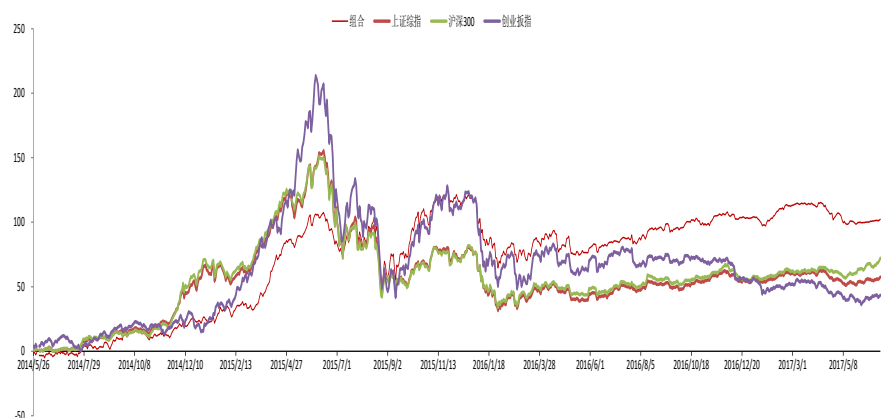
### 三、事件投资组合操作

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

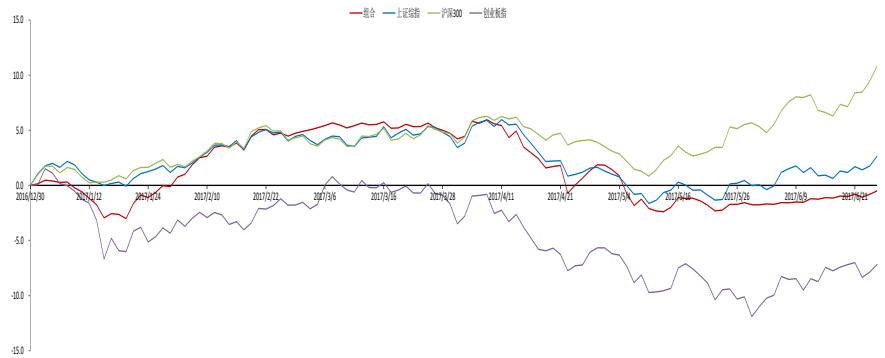
上一交易日组合收益率为 0.32%, 至 2017 年 6 月 26 日组合累计收益率为 102.22%, 分别超越上证综指、沪深 300 及创业板指 44.63、30.08 及 58.76 个百分点。

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	0.48	1.87	-5.53	-0.68	10.61	-0.49
上证综指	1.99	3.57	-2.34	1.53	10.66	2.64
沪深 300	4.24	7.53	5.82	9.87	18.08	10.82
创业板指	0.62	1.86	-7.13	-8.56	-12.94	-7.18

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: 湖北能源(股东增持)。

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	000883.SZ	湖北能源	3.00	0.20	股东增持

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

昨日建仓股票有欧比特等 1 只。

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	300053.SZ	欧比特	13.91	3.00	业绩预增

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 26 日收盘, 组合共有成分股 11 只, 仓位 33%。

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	-13.37
2	300014.SZ	亿纬锂能	2017/6/8	15.12	3.00	17.26	14.15	12.71
3	000060.SZ	中金岭南	2017/6/13	10.60	3.00	11.00	3.80	2.35
4	000665.SZ	湖北广电	2017/6/14	11.82	3.00	12.18	3.08	2.07
5	601888.SH	中国国旅	2017/6/15	28.10	3.00	28.70	2.14	0.39
6	002482.SZ	广田集团	2017/6/16	8.75	3.00	9.10	4.05	2.36
7	002138.SZ	顺络电子	2017/6/19	18.33	3.00	18.70	2.01	0.02
8	600260.SH	凯乐科技	2017/6/20	25.42	3.00	25.61	0.75	-0.55
9	600033.SH	福建高速	2017/6/21	3.95	3.00	3.99	1.13	-0.32
10	600011.SH	华能国际	2017/6/23	7.66	3.00	7.73	0.96	-0.25
11	300053.SZ	欧比特	2017/6/26	13.91	3.00	13.95	0.25	-0.62

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