

## 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7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 8873.32 亿元(+0.34%), 其中融资余额规模为 8827.75 亿元(+0.32%), 融券余额规模为 45.57 亿元(+3.98%)。从融资规模来看, 上一交易日沪深两市融资买入额为 494.6 亿元(+15.23%), 融资偿还额为 466.62 亿元(+5.8%)。
- 上一交易日, 市场指数中上证综指(-0.3%)表现最好, 创业板指(-1.07%)表现最弱; 从行业来看, 家用电器(+2.76%)、银行(+1.77%)、食品饮料(+0.85%)、非银金融(+0.28%)、商业贸易(-0.21%)等行业表现较好, 有色金属(-2.62%)、采掘(-1.98%)、计算机(-1.65%)、钢铁(-1.5%)、机械设备(-1.3%)等行业表现较弱。
- 两融标的股票中, 涨幅前五名为: 宁夏建材(+9.97%)、祁连山(+9.95%)、丰林集团(+7.54%)、海信科龙(+7.27%)和大恒科技(+7.15%); 跌幅前五名为: 远望谷(-10.01%)、贝因美(-10%)、科大讯飞(-7.75%)、陕西煤业(-6.71%)和创业环保(-6.48%); 五日量比前五名为: 莲花健康(5.89)、宁夏建材(4.89)、平安银行(4.87)、大恒科技(4.85)和普洛药业(4.81)。
- 上一交易日, 发生大宗交易的标的股票有辽宁成大、长江电力、诺德股份等 10 只。
- 今日共有 50 只标的股票停牌, 其中今日开始停牌股票有贝因美、美尔雅、海南橡胶等 3 只, 今日无复牌股票。
- 今日披露, 大股东增持标的股票有聚龙股份、航天信息等 2 只, 无大股东减持标的股票。
- 今日披露, 共有 3 只标的股票涉及增发事件, 其中中国元证券、北新路桥、力帆股份等 3 只发布董事会预案, 没有股票涉及股东大会通过, 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 103 只标的股票涉及分红送转事件, 其中有中集集团、云南白药、中山公用等 15 只为实施公告日, 南玻 A、洪都航空、鲁信创投等 73 只为股权登记日, 中天金融、东北证券、宝新能源等 15 只为除权除息日。
- 今日共有保利地产、康恩贝、江中药业等 6 只标的股票发布业绩快报, 中航地产、丽珠集团、皖能电力等 14 只标的股票发布业绩预告。
- 未来 7 个交易日共有江苏吴中、阳光电源、东华软件等 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: 华工科技(业绩预增)。
- 今日拟平仓股票有中国国旅等 1 只。
- 上一交易日组合收益率为-1.2%, 至 2017 年 7 月 11 日组合累计收益率为 103.3%, 分别超越上证综指、沪深 300 及创业板指 44.83、31.03 及 62.78 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.....   | 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.....                  | 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.....                | 14 |
| 图表 18: 未来七个交易日标的股票限售解禁.....                | 15 |
| 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 |

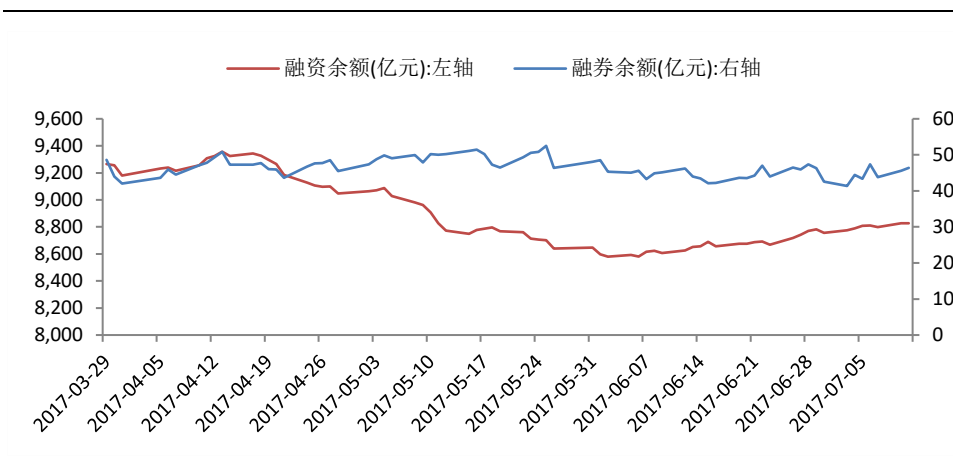
|                      |    |
|----------------------|----|
| 图表 23: 今日拟平仓股票 ..... | 16 |
| 图表 24: 昨日建仓股票 .....  | 16 |
| 图表 25: 昨日平仓股票 .....  | 17 |
| 图表 26: 组合成分股.....    | 17 |

## 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 8873.32 亿元(+0.34%)，其中融资余额规模为 8827.75 亿元(+0.32%)，融券余额规模为 45.57 亿元(+3.98%)。

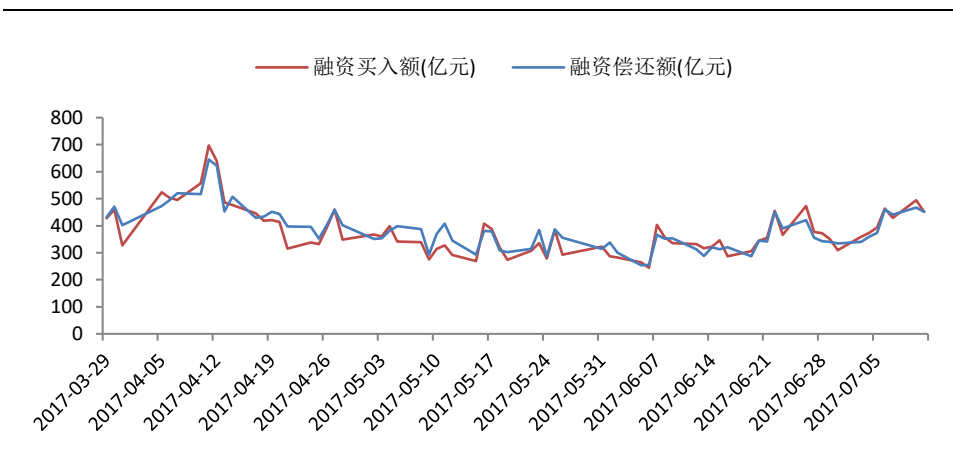
图表 1: 近三月每日融资融券余额规模(亿元)



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 494.6 亿元(+15.23%)，融资偿还额为 466.62 亿元(+5.8%)。

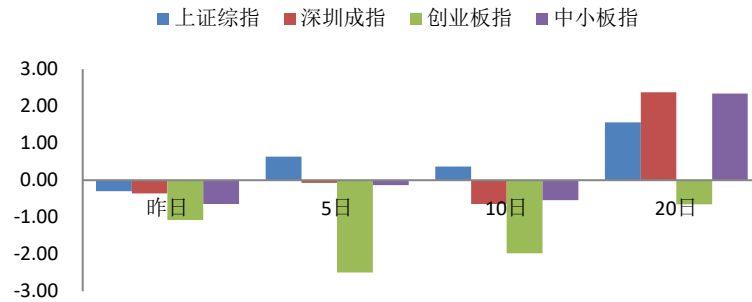
图表 2: 近三月每日融资买入额及偿还额(亿元)



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 0.3%，创业板指表现最弱，下跌 1.07%；从 5 日涨跌幅看，上证综指表现较好，上涨 0.64%，创业板指表现最弱，下跌 2.49%；从 10 日涨跌幅看，上证综指表现较好，上涨 0.37%，创业板指表现最弱，下跌 1.98%；从 20 日涨跌幅看，深证成指表现较好，上涨 2.38%，创业板指表现最弱，下跌 0.65%。

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, 有色金属(+3.76%)、电气设备(+1.79%)、综合(+1.64%)等行业增速居前, 非银金融(-1.92%)、家用电器(-2.22%)、食品饮料(-2.72%)等行业增速靠后。

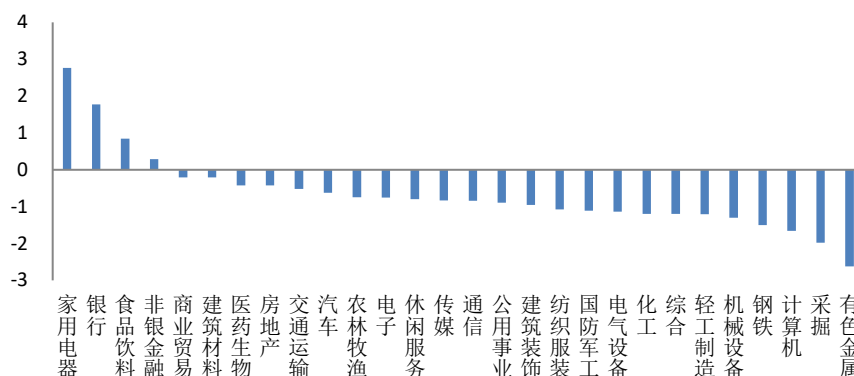
图表 4: 上一交易日两融标的股票分行业融资余额占流通市值比例及增速(%)

| 序号 | 代码        | 行业   | 融资余额占流通市值比例(%) | 占比增速(%) |
|----|-----------|------|----------------|---------|
| 1  | 801050.SI | 有色金属 | 5.38           | 3.76    |
| 2  | 801730.SI | 电气设备 | 3.93           | 1.79    |
| 3  | 801230.SI | 综合   | 8.38           | 1.64    |
| 4  | 801020.SI | 采掘   | 0.86           | 1.39    |
| 5  | 801130.SI | 纺织服装 | 3.24           | 0.92    |
| 6  | 801140.SI | 轻工制造 | 6.28           | 0.91    |
| 7  | 801740.SI | 国防军工 | 3.97           | 0.87    |
| 8  | 801030.SI | 化工   | 3.07           | 0.79    |
| 9  | 801760.SI | 传媒   | 6.67           | 0.78    |
| 10 | 801080.SI | 电子   | 5.10           | 0.73    |
| 11 | 801890.SI | 机械设备 | 3.66           | 0.71    |
| 12 | 801040.SI | 钢铁   | 2.36           | 0.52    |
| 13 | 801170.SI | 交通运输 | 2.05           | 0.39    |
| 14 | 801750.SI | 计算机  | 5.76           | 0.37    |
| 15 | 801720.SI | 建筑装饰 | 2.31           | 0.29    |
| 16 | 801160.SI | 公用事业 | 2.66           | 0.24    |
| 17 | 801150.SI | 医药生物 | 3.04           | 0.23    |
| 18 | 801770.SI | 通信   | 4.77           | 0.04    |
| 19 | 801010.SI | 农林牧渔 | 3.45           | 0.02    |
| 20 | 801880.SI | 汽车   | 2.46           | 0.00    |
| 21 | 801180.SI | 房地产  | 3.58           | -0.02   |
| 22 | 801210.SI | 休闲服务 | 2.18           | -0.37   |
| 23 | 801200.SI | 商业贸易 | 5.11           | -0.38   |
| 24 | 801780.SI | 银行   | 0.86           | -0.50   |
| 25 | 801710.SI | 建筑材料 | 4.14           | -1.30   |
| 26 | 801790.SI | 非银金融 | 2.31           | -1.92   |
| 27 | 801110.SI | 家用电器 | 1.96           | -2.22   |
| 28 | 801120.SI | 食品饮料 | 1.28           | -2.72   |

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,家用电器(+2.76%)、银行(+1.77%)、食品饮料(+0.85%)、非银金融(+0.28%)、商业贸易(-0.21%)等行业表现较好,有色金属(-2.62%)、采掘(-1.98%)、计算机(-1.65%)、钢铁(-1.5%)、机械设备(-1.3%)等行业表现较弱。

图表 5: 申万行业上一交易日涨跌幅(%)

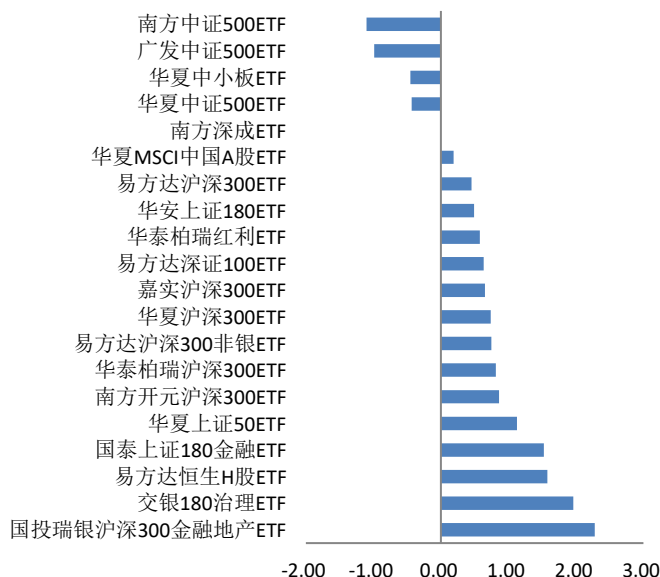


数据来源: wind、信达证券研发中心

### 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(+2.28%)、交银 180 治理 ETF(+1.96%)及易方达恒生 H 股 ETF(+1.58%);跌幅前三名为:南方中证 500ETF(-1.1%)、广发中证 500ETF(-0.99%)及华夏中小板 ETF(-0.45%)。

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:宁夏建材(+9.97%)、祁连山(+9.95%)、丰林集团(+7.54%)、海信科龙(+7.27%)和大恒科技(+7.15%);跌幅前五名为:远望谷(-10.01%)、贝因美(-10%)、科大讯飞(-7.75%)、陕西煤业(-6.71%)和创

业环保（-6.48%）。

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  | 600449.SH | 宁夏建材  | 9.97     | 4.89 | 002161.SZ | 远望谷  | -10.01   | 0.12 |
| 2  | 600720.SH | 祁连山   | 9.95     | 2.73 | 002570.SZ | 贝因美  | -10.00   | 2.94 |
| 3  | 601996.SH | 丰林集团  | 7.54     | 3.97 | 002230.SZ | 科大讯飞 | -7.75    | 1.21 |
| 4  | 000921.SZ | 海信科龙  | 7.27     | 2.21 | 601225.SH | 陕西煤业 | -6.71    | 1.57 |
| 5  | 600288.SH | 大恒科技  | 7.15     | 4.85 | 600874.SH | 创业环保 | -6.48    | 1.26 |
| 6  | 000001.SZ | 平安银行  | 6.88     | 4.87 | 603993.SH | 洛阳钼业 | -6.45    | 1.14 |
| 7  | 000022.SZ | 深赤湾 A | 6.79     | 2.08 | 600300.SH | 维维股份 | -6.25    | 1.47 |
| 8  | 600343.SH | 航天动力  | 6.65     | 3.00 | 002292.SZ | 奥飞娱乐 | -5.88    | 2.27 |
| 9  | 000651.SZ | 格力电器  | 6.32     | 1.76 | 600855.SH | 航天长峰 | -5.66    | 1.27 |
| 10 | 601628.SH | 中国人寿  | 4.65     | 1.26 | 000413.SZ | 东旭光电 | -5.41    | 0.80 |
| 11 | 002307.SZ | 北新路桥  | 4.38     | 1.73 | 002340.SZ | 格林美  | -5.18    | 0.90 |
| 12 | 002142.SZ | 宁波银行  | 4.33     | 1.95 | 000665.SZ | 湖北广电 | -5.15    | 4.05 |
| 13 | 600186.SH | 莲花健康  | 4.31     | 5.89 | 002428.SZ | 云南锗业 | -4.90    | 0.69 |
| 14 | 002236.SZ | 大华股份  | 4.29     | 1.23 | 600971.SH | 恒源煤电 | -4.87    | 1.16 |
| 15 | 002415.SZ | 海康威视  | 4.08     | 1.15 | 600711.SH | 盛屯矿业 | -4.85    | 0.75 |
| 16 | 002032.SZ | 苏泊尔   | 4.00     | 1.50 | 600160.SH | 巨化股份 | -4.80    | 1.66 |
| 17 | 600802.SH | 福建水泥  | 3.88     | 2.45 | 000338.SZ | 潍柴动力 | -4.73    | 1.27 |
| 18 | 000333.SZ | 美的集团  | 3.82     | 1.63 | 300014.SZ | 亿纬锂能 | -4.70    | 0.85 |
| 19 | 000418.SZ | 小天鹅 A | 3.64     | 1.48 | 600110.SH | 诺德股份 | -4.66    | 0.72 |
| 20 | 600036.SH | 招商银行  | 3.53     | 1.22 | 600392.SH | 盛和资源 | -4.59    | 1.39 |

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：莲花健康（5.89）、宁夏建材（4.89）、平安银行（4.87）、大恒科技（4.85）和普洛药业（4.81）。

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  | 600186.SH | 莲花健康 | 4.31     | 5.89 |
| 2  | 600449.SH | 宁夏建材 | 9.97     | 4.89 |
| 3  | 000001.SZ | 平安银行 | 6.88     | 4.87 |
| 4  | 600288.SH | 大恒科技 | 7.15     | 4.85 |
| 5  | 000739.SZ | 普洛药业 | -3.83    | 4.81 |
| 6  | 601106.SH | 中国一重 | -0.94    | 4.41 |
| 7  | 000012.SZ | 南玻 A | 3.47     | 4.06 |
| 8  | 000665.SZ | 湖北广电 | -5.15    | 4.05 |
| 9  | 601996.SH | 丰林集团 | 7.54     | 3.97 |
| 10 | 600881.SH | 亚泰集团 | 2.33     | 3.73 |
| 11 | 600838.SH | 上海九百 | 2.02     | 3.62 |
| 12 | 600624.SH | 复旦复华 | 1.57     | 3.60 |
| 13 | 601169.SH | 北京银行 | 2.30     | 3.33 |
| 14 | 600257.SH | 大湖股份 | 2.04     | 3.21 |

|    |           |      |       |      |
|----|-----------|------|-------|------|
| 15 | 002233.SZ | 塔牌集团 | 2.12  | 3.21 |
| 16 | 600000.SH | 浦发银行 | 2.15  | 3.19 |
| 17 | 600751.SH | 天海投资 | -2.18 | 3.16 |
| 18 | 600015.SH | 华夏银行 | 2.59  | 3.11 |
| 19 | 600343.SH | 航天动力 | 6.65  | 3.00 |
| 20 | 002154.SZ | 报喜鸟  | 1.32  | 2.99 |

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: 远望谷(80.42%)、农业银行(58.92%)、浙能电力(52.06%)、光大银行(40.04%)、海南海药(39.23%)。

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  | 002161.SZ | 远望谷  | -10.01   | 80.42     | 81.58      |
| 2  | 601288.SH | 农业银行 | 1.42     | 58.92     | 583.14     |
| 3  | 600023.SH | 浙能电力 | 0.55     | 52.06     | 57.74      |
| 4  | 601818.SH | 光大银行 | 1.52     | 40.04     | 273.81     |
| 5  | 000566.SZ | 海南海药 | 0.60     | 39.23     | 31.90      |
| 6  | 601939.SH | 建设银行 | 1.97     | 36.34     | 322.20     |
| 7  | 600642.SH | 申能股份 | -0.16    | 36.29     | 37.80      |
| 8  | 600016.SH | 民生银行 | 1.12     | 32.52     | 566.91     |
| 9  | 002236.SZ | 大华股份 | 4.29     | 31.93     | 264.43     |
| 10 | 000651.SZ | 格力电器 | 6.32     | 30.47     | 1595.28    |
| 11 | 601229.SH | 上海银行 | 1.28     | 30.39     | 144.12     |
| 12 | 600993.SH | 马应龙  | 1.83     | 29.49     | 54.81      |
| 13 | 000876.SZ | 新希望  | 0.61     | 28.84     | 101.87     |
| 14 | 601166.SH | 兴业银行 | 1.69     | 28.50     | 751.27     |
| 15 | 601398.SH | 工商银行 | 1.20     | 28.37     | 354.62     |
| 16 | 002032.SZ | 苏泊尔  | 4.00     | 28.14     | 41.46      |
| 17 | 601009.SH | 南京银行 | 1.90     | 27.71     | 230.93     |
| 18 | 002271.SZ | 东方雨虹 | 1.47     | 27.03     | 51.68      |
| 19 | 600015.SH | 华夏银行 | 2.59     | 26.99     | 245.39     |
| 20 | 002508.SZ | 老板电器 | 2.64     | 26.78     | 79.42      |

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: 远望谷(62.57%)、兴业证券(17.23%)、济川药业(15.59%)、格力地产(13.18%)、君正集团(12.09%); 尾盘金额流入率最高的前五名是: 海欣股份(12.59%)、梅雁吉祥(12.38%)、联化科技(9.52%)、大华股份(9.16%)、首开股份(9%)。

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  | 002161.SZ | 远望谷  | -10.01   | 62.57     | 81.58      | 600851.SH | 海欣股份 | 1.33     | 12.59     | 8.17       |
| 2  | 601377.SH | 兴业证券 | 1.18     | 17.23     | 156.18     | 600868.SH | 梅雁吉祥 | 1.43     | 12.38     | 33.00      |
| 3  | 600566.SH | 济川药业 | 0.03     | 15.59     | 13.78      | 002250.SZ | 联化科技 | -1.48    | 9.52      | 3.42       |
| 4  | 600185.SH | 格力地产 | 0.62     | 13.18     | 18.31      | 002236.SZ | 大华股份 | 4.29     | 9.16      | 77.66      |
| 5  | 601216.SH | 君正集团 | 0.00     | 12.09     | 44.00      | 600376.SH | 首开股份 | 0.26     | 9.00      | 8.35       |
| 6  | 601336.SH | 新华保险 | 0.02     | 11.28     | 45.15      | 002071.SZ | 长城影视 | -0.50    | 5.97      | 2.18       |



|    |           |      |       |       |       |           |      |       |      |        |
|----|-----------|------|-------|-------|-------|-----------|------|-------|------|--------|
| 7  | 600138.SH | 中青旅  | -0.09 | 10.20 | 8.18  | 600028.SH | 中国石化 | 0.16  | 5.94 | 23.68  |
| 8  | 600525.SH | 长园集团 | -0.87 | 10.16 | 5.17  | 600132.SH | 重庆啤酒 | 0.16  | 5.48 | 3.21   |
| 9  | 601857.SH | 中国石油 | 0.00  | 10.04 | 22.20 | 600730.SH | 中国高科 | -0.49 | 5.33 | 2.02   |
| 10 | 600702.SH | 沱牌舍得 | 1.00  | 9.11  | 18.38 | 600572.SH | 康恩贝  | -0.44 | 4.94 | 2.67   |
| 11 | 600838.SH | 上海九百 | 2.02  | 9.07  | 38.30 | 601288.SH | 农业银行 | 1.42  | 4.66 | 46.16  |
| 12 | 300226.SZ | 上海钢联 | 2.59  | 8.58  | 14.99 | 600335.SH | 国机汽车 | 1.38  | 4.26 | 1.84   |
| 13 | 601139.SH | 深圳燃气 | 0.12  | 8.38  | 0.90  | 000926.SZ | 福星股份 | 0.00  | 3.75 | 4.85   |
| 14 | 600545.SH | 新疆城建 | 1.82  | 7.85  | 21.47 | 600642.SH | 中能股份 | -0.16 | 3.46 | 3.60   |
| 15 | 600612.SH | 老凤祥  | 0.91  | 7.38  | 5.82  | 600023.SH | 浙能电力 | 0.55  | 3.44 | 3.81   |
| 16 | 601106.SH | 中国一重 | -0.94 | 7.32  | 15.85 | 002653.SZ | 海思科  | 0.80  | 3.12 | 0.49   |
| 17 | 600073.SH | 上海梅林 | -0.32 | 7.31  | 5.26  | 000651.SZ | 格力电器 | 6.32  | 3.12 | 181.21 |
| 18 | 600970.SH | 中材国际 | 1.18  | 7.28  | 28.31 | 601766.SH | 中国中车 | -0.10 | 3.03 | 12.72  |
| 19 | 000860.SZ | 顺鑫农业 | -0.05 | 7.05  | 4.02  | 002563.SZ | 森马服饰 | -0.71 | 2.87 | 1.13   |
| 20 | 002016.SZ | 世荣兆业 | 1.02  | 6.94  | 7.58  | 000895.SZ | 双汇发展 | 1.05  | 2.84 | 6.08   |

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民国技术(20.6%)、全柴动力(20.26%)、华平股份(19.74%)等, 融资余额占流通市值比例增速前十名九牧王(+15.11%)、洛阳钼业(+14.21%)、兖州煤业(+13.87%)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  | 300077.SZ | 国民技术 | 20.60           | 601566.SH | 九牧王  | 15.11    |
| 2  | 600218.SH | 全柴动力 | 20.26           | 603993.SH | 洛阳钼业 | 14.21    |
| 3  | 300074.SZ | 华平股份 | 19.74           | 600188.SH | 兖州煤业 | 13.87    |
| 4  | 002369.SZ | 卓翼科技 | 19.37           | 002570.SZ | 贝因美  | 13.76    |
| 5  | 300157.SZ | 恒泰艾普 | 19.08           | 600392.SH | 盛和资源 | 13.74    |
| 6  | 000790.SZ | 泰合健康 | 18.61           | 002176.SZ | 江特电机 | 12.67    |
| 7  | 000551.SZ | 创元科技 | 18.05           | 601225.SH | 陕西煤业 | 12.45    |
| 8  | 000917.SZ | 电广传媒 | 17.73           | 600259.SH | 广晟有色 | 11.11    |
| 9  | 600692.SH | 亚通股份 | 17.71           | 002230.SZ | 科大讯飞 | 10.89    |
| 10 | 300216.SZ | 千山药机 | 17.52           | 000739.SZ | 普洛药业 | 10.51    |

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辽宁成大、长江电力、诺德股份等 10 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  | 600739.SH | 辽宁成大 | 20.00 | 18.52    | 7.99    | 18.25 | 5000.00     | 100000.00 |
| 2  | 600900.SH | 长江电力 | 15.63 | 15.52    | 0.71    | 15.63 | 921.50      | 14403.09  |
| 3  | 600110.SH | 诺德股份 | 15.66 | 15.66    | 0.00    | 14.93 | 34.00       | 532.44    |
| 4  | 600487.SH | #N/A | 24.42 | 27.13    | -9.99   | 27.22 | 12.00       | 293.04    |
| 5  | 601211.SH | 国泰君安 | 20.72 | 20.31    | 2.02    | 20.72 | 581.20      | 12042.44  |
| 6  | 000568.SZ | 泸州老窖 | 48.32 | 48.32    | 0.00    | 49.58 | 5.00        | 241.60    |

|    |           |      |       |       |       |       |        |         |
|----|-----------|------|-------|-------|-------|-------|--------|---------|
| 7  | 000826.SZ | 启迪桑德 | 34.79 | 34.79 | 0.00  | 34.56 | 6.00   | 208.74  |
| 8  | 000333.SZ | 美的集团 | 37.25 | 41.37 | -9.96 | 42.95 | 139.00 | 5177.55 |
| 9  | 600036.SH | 招商银行 | 23.26 | 23.26 | 0.00  | 24.08 | 10.00  | 232.60  |
| 10 | 002236.SZ | 大华股份 | 23.30 | 23.30 | 0.00  | 24.30 | 30.10  | 701.33  |

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，其中今日开始停牌股票有贝因美、美尔雅、海南橡胶等 3 只，今日无复牌股票。

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  | 002570.SZ | 贝因美    | 停牌   | 2017-07-12 | 0    | 0.00       |                 |
| 2  | 600107.SH | 美尔雅    | 停牌   | 2017-07-12 | 0    | 0.00       |                 |
| 3  | 601118.SH | 海南橡胶   | 停牌   | 2017-07-12 | 0    | 0.00       |                 |
| 4  | 002701.SZ | 奥瑞金    | 停牌   | 2017-07-11 | 1    | -0.30      | 拟披露重大事项         |
| 5  | 600209.SH | 罗顿发展   | 停牌   | 2017-07-11 | 1    | -0.30      | 重要事项未公告         |
| 6  | 600135.SH | 乐凯胶片   | 停牌   | 2017-07-10 | 2    | -0.46      | 重要事项未公告         |
| 7  | 000812.SZ | 陕西金叶   | 停牌   | 2017-07-06 | 6    | -0.13      | 重大事项            |
| 8  | 601999.SH | 出版传媒   | 停牌   | 2017-07-03 | 9    | 0.33       | 重要事项未公告         |
| 9  | 000061.SZ | 农产品    | 停牌   | 2017-06-28 | 14   | 0.37       | 重大事项            |
| 10 | 000700.SZ | 模塑科技   | 停牌   | 2017-06-28 | 14   | 0.37       | 重大事项            |
| 11 | 600239.SH | 云南城投   | 停牌   | 2017-06-26 | 16   | 1.43       | 重大资产重组          |
| 12 | 601001.SH | 大同煤业   | 停牌   | 2017-06-22 | 20   | 1.48       | 重要事项未公告         |
| 13 | 600654.SH | 中安消    | 停牌   | 2017-06-07 | 35   | 3.25       | 重大资产重组          |
| 14 | 600795.SH | 国电电力   | 停牌   | 2017-06-05 | 37   | 3.14       | 重大资产重组          |
| 15 | 601088.SH | 中国神华   | 停牌   | 2017-06-05 | 37   | 3.14       | 重要事项未公告         |
| 16 | 600193.SH | 创兴资源   | 停牌   | 2017-06-01 | 41   | 2.75       | 重大资产重组          |
| 17 | 601989.SH | 中国重工   | 停牌   | 2017-05-31 | 42   | 2.99       | 重大资产重组          |
| 18 | 601919.SH | 中远海控   | 停牌   | 2017-05-17 | 56   | 2.89       | 重大资产重组          |
| 19 | 600460.SH | 士兰微    | 停牌   | 2017-05-12 | 61   | 4.62       | 重大资产重组          |
| 20 | 000503.SZ | 海虹控股   | 停牌   | 2017-05-11 | 62   | 4.92       | 重大资产重组          |
| 21 | 600289.SH | 亿阳信通   | 停牌   | 2017-05-10 | 63   | 3.98       | 重要事项未公告         |
| 22 | 600653.SH | 申华控股   | 停牌   | 2017-05-08 | 65   | 3.22       | 重大资产重组          |
| 23 | 000099.SZ | 中信海直   | 停牌   | 2017-05-04 | 69   | 2.16       | 重大资产重组          |
| 24 | 002070.SZ | *ST 众和 | 停牌   | 2017-05-02 | 71   | 1.53       | 重大资产重组          |
| 25 | 601872.SH | 招商轮船   | 停牌   | 2017-05-02 | 71   | 1.53       | 重要事项未公告         |
| 26 | 002399.SZ | 海普瑞    | 停牌   | 2017-04-28 | 75   | 1.61       | 重大事项            |
| 27 | 000887.SZ | 中鼎股份   | 停牌   | 2017-04-27 | 76   | 1.98       | 重大事项            |
| 28 | 600318.SH | 新力金融   | 停牌   | 2017-04-27 | 76   | 1.98       | 公司申请停牌对相关事项进行核查 |
| 29 | 000506.SZ | 中润资源   | 停牌   | 2017-04-25 | 78   | 2.35       | 重大资产重组          |
| 30 | 600568.SH | 中珠医疗   | 停牌   | 2017-04-25 | 78   | 2.35       | 重大资产重组          |
| 31 | 601717.SH | 郑煤机    | 停牌   | 2017-04-24 | 79   | 0.94       | 重大资产重组          |

|    |           |        |    |            |     |       |         |
|----|-----------|--------|----|------------|-----|-------|---------|
| 32 | 000100.SZ | TCL 集团 | 停牌 | 2017-04-21 | 82  | 0.98  | 重大事项    |
| 33 | 002252.SZ | 上海莱士   | 停牌 | 2017-04-21 | 82  | 0.98  | 重大事项    |
| 34 | 600100.SH | 同方股份   | 停牌 | 2017-04-21 | 82  | 0.98  | 重大资产重组  |
| 35 | 601608.SH | 中信重工   | 停牌 | 2017-04-19 | 84  | 0.20  | 重要事项未公告 |
| 36 | 300104.SZ | 乐视网    | 停牌 | 2017-04-17 | 86  | -1.33 | 重大资产重组  |
| 37 | 600643.SH | 爱建集团   | 停牌 | 2017-04-17 | 86  | -1.33 | 重大资产重组  |
| 38 | 600050.SH | 中国联通   | 停牌 | 2017-04-05 | 98  | -0.60 | 重要事项未公告 |
| 39 | 600609.SH | 金杯汽车   | 停牌 | 2017-03-20 | 114 | -1.06 | 重大资产重组  |
| 40 | 002128.SZ | 露天煤业   | 停牌 | 2017-03-17 | 117 | -2.02 | 重大资产重组  |
| 41 | 600277.SH | 亿利洁能   | 停牌 | 2017-03-06 | 128 | -0.47 | 重大资产重组  |
| 42 | 600490.SH | 鹏欣资源   | 停牌 | 2017-02-21 | 141 | -1.14 | 重大资产重组  |
| 43 | 002049.SZ | 紫光国芯   | 停牌 | 2017-02-20 | 142 | 0.03  | 重大资产重组  |
| 44 | 600559.SH | 老白干酒   | 停牌 | 2017-01-23 | 170 | 2.56  | 重大资产重组  |
| 45 | 600146.SH | 商赢环球   | 停牌 | 2017-01-05 | 188 | 1.40  | 重大资产重组  |
| 46 | 600485.SH | 信威集团   | 停牌 | 2016-12-26 | 198 | 2.99  | 重大资产重组  |
| 47 | 600655.SH | 豫园商城   | 停牌 | 2016-12-20 | 204 | 2.72  | 重大资产重组  |
| 48 | 600673.SH | 东阳光科   | 停牌 | 2016-11-15 | 239 | -0.23 | 重大资产重组  |
| 49 | 300088.SZ | 长信科技   | 停牌 | 2016-09-12 | 303 | 4.03  | 重大资产重组  |
| 50 | 002129.SZ | 中环股份   | 停牌 | 2016-04-25 | 443 | 8.24  | 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聚龙股份、航天信息等 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  | 300202.SZ | 聚龙股份 | 2017/7/12 | 2017/7/11 | 增持   | 0.38          | 0.00           |             |       | 16.71    | 0.30     |
| 2  | 600271.SH | 航天信息 | 2017/7/12 | 2017/7/7  | 增持   | 0.00          | 0.00           | 0.00        | 21.18 | 20.20    | -1.32    |

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, 其中国元证券、北新路桥、力帆股份等 3 只发布董事会预案, 没有股票涉及股东大会通过, 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  | 000728.SZ | 国元证券 | 2017-07-12 | 董事会预案 | 9.25 | 定向   | 12.64 | -0.55    |
| 2  | 002307.SZ | 北新路桥 | 2017-07-12 | 董事会预案 |      | 定向   | 19.55 | 4.38     |
| 3  | 601777.SH | 力帆股份 | 2017-07-12 | 董事会预案 |      | 定向   | 8.10  | -0.37    |

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 103 只标的股票涉及分红送转事件, 其中有中集集团、云南白药、

中山公用等 15 只为实施公告日，南玻 A、洪都航空、鲁信创投等 73 只为股权登记日，中天金融、东北证券、宝新能源等 15 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<br>分红 | 每股股利<br>(税前) | 事件    | 前收盘<br>价(元) | 前涨跌<br>幅(%) | 股息率<br>(%) | 每股红股及<br>转增股本 |
|----|-----------|------|-----------|----------|--------------|-------|-------------|-------------|------------|---------------|
| 1  | 000039.SZ | 中集集团 | 2017/7/12 | 是        | 0.06         | 实施公告日 | 17.57       | 1.91        | 0.34       |               |
| 2  | 000538.SZ | 云南白药 | 2017/7/12 | 是        | 0.80         | 实施公告日 | 91.30       | 0.84        | 0.88       |               |
| 3  | 000685.SZ | 中山公用 | 2017/7/12 | 是        | 0.20         | 实施公告日 | 11.11       | -0.45       | 1.80       |               |
| 4  | 000883.SZ | 湖北能源 | 2017/7/12 | 是        | 0.09         | 实施公告日 | 4.98        | -0.40       | 1.83       |               |
| 5  | 600028.SH | 中国石化 | 2017/7/12 | 是        | 0.17         | 实施公告日 | 6.15        | 0.16        | 2.76       |               |
| 6  | 600060.SH | 海信电器 | 2017/7/12 | 是        | 0.40         | 实施公告日 | 14.87       | 0.61        | 2.72       |               |
| 7  | 600216.SH | 浙江医药 | 2017/7/12 | 是        | 0.15         | 实施公告日 | 9.96        | 0.10        | 1.46       |               |
| 8  | 600257.SH | 大湖股份 | 2017/7/12 | 是        | 0.02         | 实施公告日 | 7.51        | 2.04        | 0.27       |               |
| 9  | 600594.SH | 益佰制药 | 2017/7/12 | 是        | 0.06         | 实施公告日 | 14.95       | 0.40        | 0.40       |               |
| 10 | 600616.SH | 金枫酒业 | 2017/7/12 | 是        | 0.05         | 实施公告日 | 10.71       | -1.83       | 0.47       |               |
| 11 | 600720.SH | 祁连山  | 2017/7/12 | 是        | 0.07         | 实施公告日 | 9.17        | 9.95        | 0.71       |               |
| 12 | 601009.SH | 南京银行 | 2017/7/12 | 是        | 0.26         | 实施公告日 | 11.28       | 1.90        | 2.30       | 0.40          |
| 13 | 601229.SH | 上海银行 | 2017/7/12 | 是        | 0.50         | 实施公告日 | 25.33       | 1.28        | 1.97       | 0.30          |
| 14 | 601718.SH | 际华集团 | 2017/7/12 | 是        | 0.05         | 实施公告日 | 8.76        | 0.46        | 0.55       |               |
| 15 | 601788.SH | 光大证券 | 2017/7/12 | 是        | 0.20         | 实施公告日 | 15.08       | 0.20        | 1.33       |               |
| 16 | 000012.SZ | 南玻 A | 2017/7/18 | 是        | 0.10         | 股权登记日 | 9.85        | 3.47        | 1.02       | 0.15          |
| 17 | 600316.SH | 洪都航空 | 2017/7/18 | 是        | 0.01         | 股权登记日 | 16.18       | -1.40       | 0.04       |               |
| 18 | 600783.SH | 鲁信创投 | 2017/7/18 | 是        | 0.15         | 股权登记日 | 17.27       | -1.65       | 0.87       |               |
| 19 | 601186.SH | 中国铁建 | 2017/7/18 | 是        | 0.16         | 股权登记日 | 12.11       | 0.00        | 1.32       |               |
| 20 | 000423.SZ | 东阿阿胶 | 2017/7/17 | 是        | 0.90         | 股权登记日 | 68.90       | 0.69        | 1.31       |               |
| 21 | 002065.SZ | 东华软件 | 2017/7/17 | 是        | 0.15         | 股权登记日 | 21.40       | -0.65       | 0.70       | 1.00          |
| 22 | 002310.SZ | 东方园林 | 2017/7/17 | 是        | 0.03         | 股权登记日 | 17.79       | -2.20       | 0.17       |               |
| 23 | 300203.SZ | 聚光科技 | 2017/7/17 | 是        | 0.15         | 股权登记日 | 29.27       | -0.44       | 0.51       |               |
| 24 | 600018.SH | 上港集团 | 2017/7/17 | 是        | 0.16         | 股权登记日 | 6.56        | -0.61       | 2.38       |               |
| 25 | 600388.SH | 龙净环保 | 2017/7/17 | 是        | 0.19         | 股权登记日 | 14.95       | -0.53       | 1.27       |               |
| 26 | 600820.SH | 隧道股份 | 2017/7/17 | 是        | 0.16         | 股权登记日 | 9.98        | -1.09       | 1.60       |               |
| 27 | 601618.SH | 中国中冶 | 2017/7/17 | 是        | 0.06         | 股权登记日 | 4.99        | -0.80       | 1.20       |               |
| 28 | 000712.SZ | 锦龙股份 | 2017/7/14 | 是        | 0.10         | 股权登记日 | 17.75       | -1.39       | 0.56       |               |
| 29 | 000979.SZ | 中弘股份 | 2017/7/14 | 是        | 0.01         | 股权登记日 | 2.69        | -0.37       | 0.37       | 0.40          |
| 30 | 002287.SZ | 奇正藏药 | 2017/7/14 | 是        | 0.39         | 股权登记日 | 40.50       | -1.77       | 0.96       |               |
| 31 | 002378.SZ | 章源钨业 | 2017/7/14 | 是        | 0.02         | 股权登记日 | 9.63        | -4.08       | 0.16       |               |
| 32 | 002470.SZ | 金正大  | 2017/7/14 | 是        | 0.10         | 股权登记日 | 7.53        | 0.27        | 1.33       |               |
| 33 | 300273.SZ | 和佳股份 | 2017/7/14 | 是        | 0.02         | 股权登记日 | 11.58       | -1.28       | 0.13       |               |
| 34 | 600062.SH | 华润双鹤 | 2017/7/14 | 是        | 0.10         | 股权登记日 | 25.63       | 0.63        | 0.39       | 0.20          |
| 35 | 600088.SH | 中视传媒 | 2017/7/14 | 是        | 0.03         | 股权登记日 | 16.58       | -0.78       | 0.15       |               |
| 36 | 600332.SH | 白云山  | 2017/7/14 | 是        | 0.28         | 股权登记日 | 27.92       | -0.85       | 1.00       |               |
| 37 | 600466.SH | 蓝光发展 | 2017/7/14 | 是        | 0.10         | 股权登记日 | 8.44        | -2.99       | 1.18       |               |
| 38 | 600509.SH | 天富能源 | 2017/7/14 | 是        | 0.11         | 股权登记日 | 7.79        | -1.27       | 1.37       |               |
| 39 | 600612.SH | 老凤祥  | 2017/7/14 | 是        | 1.00         | 股权登记日 | 45.27       | 0.91        | 2.21       |               |
| 40 | 600775.SH | 南京熊猫 | 2017/7/14 | 是        | 0.07         | 股权登记日 | 11.14       | 2.01        | 0.63       |               |

|    |           |       |           |   |      |       |       |       |      |      |
|----|-----------|-------|-----------|---|------|-------|-------|-------|------|------|
| 41 | 000415.SZ | 渤海金控  | 2017/7/13 | 是 | 0.05 | 股权登记日 | 6.88  | -1.15 | 0.73 |      |
| 42 | 000516.SZ | 国际医学  | 2017/7/13 | 是 | 0.03 | 股权登记日 | 5.43  | -1.81 | 0.55 |      |
| 43 | 000725.SZ | 京东方 A | 2017/7/13 | 是 | 0.03 | 股权登记日 | 4.02  | 0.00  | 0.75 |      |
| 44 | 000778.SZ | 新兴铸管  | 2017/7/13 | 是 | 0.03 | 股权登记日 | 6.67  | -1.91 | 0.45 |      |
| 45 | 000997.SZ | 新大陆   | 2017/7/13 | 是 | 0.06 | 股权登记日 | 21.95 | -3.43 | 0.27 |      |
| 46 | 000998.SZ | 隆平高科  | 2017/7/13 | 是 | 0.15 | 股权登记日 | 22.81 | -1.34 | 0.66 |      |
| 47 | 000999.SZ | 华润三九  | 2017/7/13 | 是 | 0.16 | 股权登记日 | 29.80 | 1.43  | 0.54 |      |
| 48 | 001696.SZ | 宗申动力  | 2017/7/13 | 是 | 0.03 | 股权登记日 | 7.48  | -1.58 | 0.40 |      |
| 49 | 002071.SZ | 长城影视  | 2017/7/13 | 是 | 0.05 | 股权登记日 | 9.90  | -0.50 | 0.53 |      |
| 50 | 002093.SZ | 国脉科技  | 2017/7/13 | 是 | 0.01 | 股权登记日 | 8.85  | 0.11  | 0.11 |      |
| 51 | 002375.SZ | 亚厦股份  | 2017/7/13 | 是 | 0.04 | 股权登记日 | 8.91  | -0.67 | 0.45 |      |
| 52 | 300093.SZ | 金刚玻璃  | 2017/7/13 | 是 | 0.00 | 股权登记日 | 13.45 | -3.24 | 0.01 |      |
| 53 | 300168.SZ | 万达信息  | 2017/7/13 | 是 | 0.03 | 股权登记日 | 14.49 | -0.96 | 0.21 |      |
| 54 | 600004.SH | 白云机场  | 2017/7/13 | 是 | 0.37 | 股权登记日 | 19.59 | 0.93  | 1.89 | 0.45 |
| 55 | 600006.SH | 东风汽车  | 2017/7/13 | 是 | 0.03 | 股权登记日 | 5.96  | -1.97 | 0.55 |      |
| 56 | 600119.SH | 长江投资  | 2017/7/13 | 是 | 0.14 | 股权登记日 | 14.84 | -2.56 | 0.92 |      |
| 57 | 600157.SH | 永泰能源  | 2017/7/13 | 是 | 0.01 | 股权登记日 | 3.65  | -1.35 | 0.30 |      |
| 58 | 600188.SH | 兖州煤业  | 2017/7/13 | 是 | 0.12 | 股权登记日 | 12.68 | -3.35 | 0.95 |      |
| 59 | 600329.SH | 中新药业  | 2017/7/13 | 是 | 0.15 | 股权登记日 | 17.73 | -0.95 | 0.85 |      |
| 60 | 600350.SH | 山东高速  | 2017/7/13 | 是 | 0.20 | 股权登记日 | 6.45  | -0.46 | 3.04 |      |
| 61 | 600503.SH | 华丽家族  | 2017/7/13 | 是 | 0.02 | 股权登记日 | 6.80  | -4.49 | 0.35 |      |
| 62 | 600640.SH | 号百控股  | 2017/7/13 | 是 | 0.01 | 股权登记日 | 16.74 | -2.33 | 0.04 |      |
| 63 | 600668.SH | 尖峰集团  | 2017/7/13 | 是 | 0.25 | 股权登记日 | 17.41 | -1.19 | 1.44 |      |
| 64 | 600674.SH | 川投能源  | 2017/7/13 | 是 | 0.30 | 股权登记日 | 9.97  | 0.20  | 3.01 |      |
| 65 | 600804.SH | 鹏博士   | 2017/7/13 | 是 | 0.17 | 股权登记日 | 17.10 | -0.47 | 0.96 |      |
| 66 | 600809.SH | 山西汾酒  | 2017/7/13 | 是 | 0.55 | 股权登记日 | 34.15 | 1.61  | 1.61 |      |
| 67 | 600826.SH | 兰生股份  | 2017/7/13 | 是 | 0.60 | 股权登记日 | 19.24 | -1.74 | 3.12 |      |
| 68 | 600900.SH | 长江电力  | 2017/7/13 | 是 | 0.65 | 股权登记日 | 15.63 | 0.71  | 4.16 |      |
| 69 | 601117.SH | 中国化学  | 2017/7/13 | 是 | 0.11 | 股权登记日 | 6.99  | -1.27 | 1.55 |      |
| 70 | 601607.SH | 上海医药  | 2017/7/13 | 是 | 0.36 | 股权登记日 | 27.68 | 0.76  | 1.30 |      |
| 71 | 601669.SH | 中国电建  | 2017/7/13 | 是 | 0.09 | 股权登记日 | 7.98  | -0.37 | 1.07 |      |
| 72 | 601988.SH | 中国银行  | 2017/7/13 | 是 | 0.17 | 股权登记日 | 3.72  | 0.81  | 4.52 |      |
| 73 | 000046.SZ | 泛海控股  | 2017/7/12 | 是 | 0.15 | 股权登记日 | 8.41  | -1.06 | 1.78 |      |
| 74 | 001979.SZ | 招商蛇口  | 2017/7/12 | 是 | 0.50 | 股权登记日 | 20.72 | 0.39  | 2.41 |      |
| 75 | 300002.SZ | 神州泰岳  | 2017/7/12 | 是 | 0.03 | 股权登记日 | 8.31  | -1.89 | 0.31 |      |
| 76 | 600323.SH | 瀚蓝环境  | 2017/7/12 | 是 | 0.20 | 股权登记日 | 14.53 | -1.42 | 1.38 |      |
| 77 | 600377.SH | 宁沪高速  | 2017/7/12 | 是 | 0.42 | 股权登记日 | 10.10 | 1.00  | 4.16 |      |
| 78 | 600528.SH | 中铁工业  | 2017/7/12 | 是 | 0.02 | 股权登记日 | 14.79 | 0.48  | 0.16 |      |
| 79 | 600568.SH | 中珠医疗  | 2017/7/12 | 是 | 0.05 | 股权登记日 | 19.16 | 0.00  | 0.26 | 1.80 |
| 80 | 600639.SH | 浦东金桥  | 2017/7/12 | 是 | 0.17 | 股权登记日 | 17.91 | -0.94 | 0.95 |      |
| 81 | 600688.SH | 上海石化  | 2017/7/12 | 是 | 0.25 | 股权登记日 | 6.71  | 0.60  | 3.73 |      |
| 82 | 600872.SH | 中炬高新  | 2017/7/12 | 是 | 0.14 | 股权登记日 | 17.95 | -1.16 | 0.78 |      |
| 83 | 600874.SH | 创业环保  | 2017/7/12 | 是 | 0.10 | 股权登记日 | 18.04 | -6.48 | 0.53 |      |
| 84 | 600978.SH | 宜华生活  | 2017/7/12 | 是 | 0.06 | 股权登记日 | 9.74  | -0.92 | 0.56 |      |
| 85 | 601288.SH | 农业银行  | 2017/7/12 | 是 | 0.17 | 股权登记日 | 3.58  | 1.42  | 4.75 |      |
| 86 | 601777.SH | 力帆股份  | 2017/7/12 | 是 | 0.05 | 股权登记日 | 8.10  | -0.37 | 0.62 |      |

|     |           |      |           |   |      |       |       |       |      |  |
|-----|-----------|------|-----------|---|------|-------|-------|-------|------|--|
| 87  | 601929.SH | 吉视传媒 | 2017/7/12 | 是 | 0.03 | 股权登记日 | 3.46  | -1.42 | 0.72 |  |
| 88  | 601999.SH | 出版传媒 | 2017/7/12 | 是 | 0.05 | 股权登记日 | 9.12  | 0.00  | 0.52 |  |
| 89  | 000540.SZ | 中天金融 | 2017/7/12 | 是 | 0.20 | 除权除息日 | 6.92  | -0.72 | 2.89 |  |
| 90  | 000686.SZ | 东北证券 | 2017/7/12 | 是 | 0.10 | 除权除息日 | 10.14 | -0.98 | 0.99 |  |
| 91  | 000690.SZ | 宝新能源 | 2017/7/12 | 是 | 0.03 | 除权除息日 | 5.79  | -1.36 | 0.57 |  |
| 92  | 000921.SZ | 海信科龙 | 2017/7/12 | 是 | 0.30 | 除权除息日 | 17.11 | 7.27  | 1.75 |  |
| 93  | 002063.SZ | 远光软件 | 2017/7/12 | 是 | 0.05 | 除权除息日 | 10.42 | -1.51 | 0.48 |  |
| 94  | 002203.SZ | 海亮股份 | 2017/7/12 | 是 | 0.06 | 除权除息日 | 8.31  | -2.92 | 0.72 |  |
| 95  | 002266.SZ | 浙富控股 | 2017/7/12 | 是 | 0.01 | 除权除息日 | 4.96  | -0.60 | 0.20 |  |
| 96  | 002573.SZ | 清新环境 | 2017/7/12 | 是 | 0.10 | 除权除息日 | 18.43 | -1.18 | 0.54 |  |
| 97  | 300315.SZ | 掌趣科技 | 2017/7/12 | 是 | 0.02 | 除权除息日 | 8.10  | 0.12  | 0.23 |  |
| 98  | 600240.SH | 华业资本 | 2017/7/12 | 是 | 0.10 | 除权除息日 | 8.90  | -0.67 | 1.12 |  |
| 99  | 600362.SH | 江西铜业 | 2017/7/12 | 是 | 0.15 | 除权除息日 | 17.02 | -2.07 | 0.88 |  |
| 100 | 600387.SH | 海越股份 | 2017/7/12 | 是 | 0.06 | 除权除息日 | 11.93 | -2.21 | 0.50 |  |

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

今日共有保利地产、康恩贝、江中药业等 6 只标的股票发布业绩快报，中航地产、丽珠集团、皖能电力等 14 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  | 000043.SZ | 中航地产 | 半年度预告 | 首亏     | -4858.72 | 11.03 | 0.36    |
| 2  | 000513.SZ | 丽珠集团 | 半年度预告 | 略增     | 30.00    | 49.29 | 1.19    |
| 3  | 000543.SZ | 皖能电力 | 半年度预告 | 首亏     | -112.73  | 5.77  | -0.86   |
| 4  | 000626.SZ | 远大控股 | 半年度预告 | 略减     | -37.97   | 19.45 | -1.97   |
| 5  | 000899.SZ | 赣能股份 | 半年度预告 | 预减     | -65.62   | 8.41  | -3.78   |
| 6  | 000957.SZ | 中通客车 | 半年度预告 | 预减     | -83.00   | 12.02 | -1.23   |
| 7  | 000988.SZ | 华工科技 | 半年度预告 | 预增     | 55.18    | 14.99 | -1.32   |
| 8  | 002128.SZ | 露天煤业 | 半年度预告 | 预增     | 210.00   | 8.70  | 0.00    |
| 9  | 300010.SZ | 立思辰  | 半年度预告 | 略增     | 30.00    | 12.83 | -2.06   |
| 10 | 300058.SZ | 蓝色光标 | 半年度预告 | 略减     | -20.15   | 7.63  | -2.80   |
| 11 | 300093.SZ | 金刚玻璃 | 半年度预告 | 预增     | 1231.01  | 13.45 | -3.24   |
| 12 | 300212.SZ | 易华录  | 半年度预告 | 略增     | 20.00    | 26.62 | 1.10    |
| 13 | 600123.SH | 兰花科创 | 半年度预告 | 扭亏     | 385.18   | 7.92  | -2.82   |
| 14 | 600409.SH | 三友化工 | 半年度预告 | 预增     | 227.00   | 10.37 | -2.54   |
| 15 | 600048.SH | 保利地产 | 半年度快报 |        | 1.43     | 10.39 | 0.39    |
| 16 | 600572.SH | 康恩贝  | 半年度快报 |        | 26.09    | 6.79  | -0.44   |
| 17 | 600750.SH | 江中药业 | 半年度快报 |        | 6.39     | 32.40 | -0.86   |
| 18 | 601139.SH | 深圳燃气 | 半年度快报 |        | 5.51     | 8.60  | 0.12    |
| 19 | 601933.SH | 永辉超市 | 半年度快报 |        | 52.48    | 7.26  | 2.40    |
| 20 | 603766.SH | 隆鑫通用 | 半年度快报 |        | 13.31    | 7.19  | -0.69   |

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 个交易日共有江苏吴中、阳光电源、东华软件等 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  | 600200.SH | 江苏吴中 | 2017/7/12 | 556.67   | 0.77         | 93.31075205 | 13.26 | -0.38   |
| 2  | 300274.SZ | 阳光电源 | 2017/7/13 | 21600.00 | 14.91        | 72.98440068 | 10.71 | -0.46   |
| 3  | 002065.SZ | 东华软件 | 2017/7/17 | 2921.26  | 1.86         | 89.01995975 | 21.40 | -0.65   |
| 4  | 600141.SH | 兴发集团 | 2017/7/17 | 3194.01  | 6.24         | 100         | 12.60 | -2.25   |
| 5  | 600690.SH | 青岛海尔 | 2017/7/17 | 60598.60 | 9.94         | 99.99626084 | 14.51 | 2.62    |
| 6  | 600276.SH | 恒瑞医药 | 2017/7/17 | 434.18   | 0.15         | 99.99064294 | 49.52 | 0.41    |
| 7  | 600867.SH | 通化东宝 | 2017/7/18 | 348.48   | 0.20         | 96.08090135 | 17.56 | -0.28   |
| 8  | 000937.SZ | 冀中能源 | 2017/7/18 | 52679.74 | 14.91        | 97.16574798 | 6.28  | -3.53   |
| 9  | 600335.SH | 国机汽车 | 2017/7/18 | 7857.86  | 7.63         | 91.35523769 | 11.77 | 1.38    |
| 10 | 600422.SH | 昆药集团 | 2017/7/20 | 103.43   | 0.13         | 86.46424415 | 11.16 | -0.89   |
| 11 | 600151.SH | 航天机电 | 2017/7/20 | 13851.58 | 9.66         | 96.82367179 | 8.31  | -1.89   |

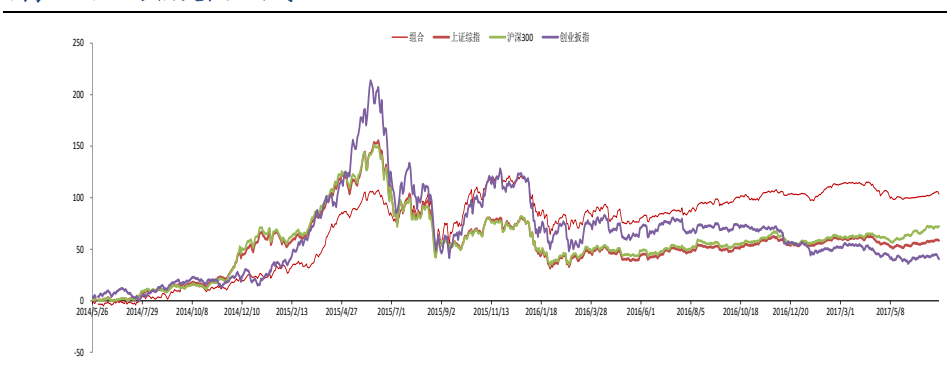
数据来源: wind、信达证券研发中心

### 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。

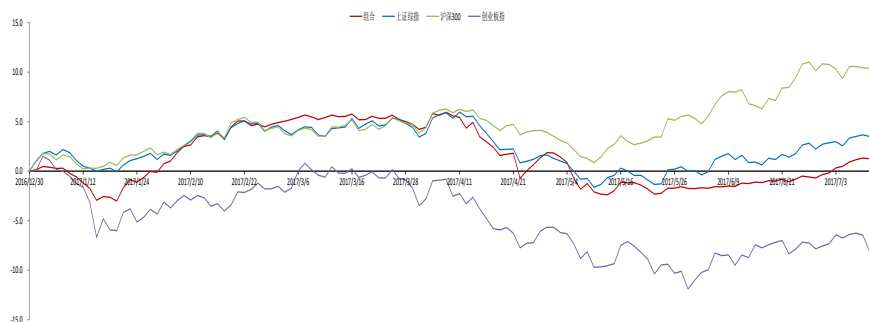
#### 1. 组合历史收益

上一交易日组合收益率为-1.2%, 至 2017 年 7 月 11 日组合累计收益率为 103.3%, 分别超越上证综指、沪深 300 及创业板指 44.83、31.03 及 62.78 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     | -0.44 | 1.57  | -5.26 | -0.26 | 9.80   | 0.04  |
| 上证综指   | 0.22  | 1.67  | -2.54 | 1.54  | 6.16   | 3.20  |
| 沪深 300 | 0.55  | 3.08  | 4.36  | 9.65  | 14.11  | 10.90 |
| 创业板指   | -2.84 | -0.60 | -8.33 | -9.22 | -20.42 | -9.08 |

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: 华工科技(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  | 000988.SZ | 华工科技 | 3.00  | -1.32   | 业绩预增 |
| 2  |           |      |       |         | 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

今日拟平仓股票有中国国旅等 1 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  | 601888.SH | 中国国旅 | 2017/6/15 | 3.00  | 2.99      |

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

昨日建仓股票有德赛电池、华胜天成等 2 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  | 000049.SZ | 德赛电池 | 53.12 | 3.00  | 业绩预增 |
| 2  | 600410.SH | 华胜天成 | 9.25  | 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

昨日平仓股票有湖北广电等 1 只。

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  | 000665.SZ | 湖北广电 | 2017/06/14 | 11.90 | 3.00  | 11.93 | 0.29      |

数据来源: wind、信达证券研发中心

## 4. 组合成分股

至 2017 年 7 月 11 日收盘, 组合共有成分股 20 只, 仓位 60.01%。

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  | 002129.SZ | 中环股份 | 2016/4/1  | 8.92  | 3.00  | 8.27  | -7.29    | -13.92   |
| 2  | 601888.SH | 中国国旅 | 2017/6/15 | 28.10 | 3.00  | 28.94 | 2.99     | 0.68     |
| 3  | 002482.SZ | 广田集团 | 2017/6/16 | 8.75  | 3.00  | 9.02  | 3.09     | 0.83     |
| 4  | 002138.SZ | 顺络电子 | 2017/6/19 | 18.33 | 3.00  | 18.30 | -0.16    | -2.72    |
| 5  | 600260.SH | 凯乐科技 | 2017/6/20 | 25.42 | 3.00  | 26.48 | 4.17     | 2.30     |
| 6  | 600033.SH | 福建高速 | 2017/6/21 | 3.80  | 3.00  | 3.83  | 0.79     | -1.22    |
| 7  | 600011.SH | 华能国际 | 2017/6/23 | 7.66  | 3.00  | 7.22  | -5.74    | -7.51    |
| 8  | 300053.SZ | 欧比特  | 2017/6/26 | 13.91 | 3.00  | 13.14 | -5.54    | -6.97    |
| 9  | 000883.SZ | 湖北能源 | 2017/6/27 | 5.00  | 3.00  | 4.98  | -0.40    | -0.95    |
| 10 | 300146.SZ | 汤臣倍健 | 2017/6/28 | 12.87 | 3.00  | 13.05 | 1.40     | 1.03     |
| 11 | 600067.SH | 冠城大通 | 2017/6/30 | 6.91  | 3.00  | 6.88  | -0.43    | -0.90    |
| 12 | 600256.SH | 广汇能源 | 2017/7/3  | 4.18  | 3.00  | 4.19  | 0.24     | -0.09    |
| 13 | 600711.SH | 盛屯矿业 | 2017/7/4  | 6.99  | 3.00  | 7.26  | 3.86     | 3.64     |
| 14 | 600110.SH | 诺德股份 | 2017/7/5  | 14.55 | 3.00  | 14.93 | 2.61     | 1.98     |
| 15 | 601678.SH | 滨化股份 | 2017/7/6  | 7.30  | 3.00  | 7.28  | -0.25    | -0.12    |
| 16 | 601006.SH | 大秦铁路 | 2017/7/7  | 8.68  | 3.00  | 8.83  | 1.69     | 1.98     |
| 17 | 600307.SH | 酒钢宏兴 | 2017/7/10 | 3.06  | 3.00  | 2.97  | -2.99    | -2.53    |
| 18 | 600893.SH | 中航动力 | 2017/7/10 | 28.34 | 3.00  | 28.27 | -0.25    | 0.22     |
| 19 | 000049.SZ | 德赛电池 | 2017/7/11 | 53.12 | 3.00  | 52.84 | -0.52    | -0.22    |
| 20 | 600410.SH | 华胜天成 | 2017/7/11 | 9.25  | 3.00  | 9.12  | -1.42    | -1.12    |

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 | yiyaohua@cindasc.com     |
| 国际 | 唐 蕾 | 010-63080945  | 18610350427 | tanglei@cindasc.com      |
| 国际 | 王小乐 | 010-63081122  | 18301418636 | wangxiaole@cindasc.com   |