

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31日

本期内容提要:

- 上一交易日, 沪深两市融资融券余额规模为 8842.08 亿元(+0.13%), 其中融资余额规模为 8792.81 亿元(+0.13%), 融券余额规模为 49.27 亿元(+0.19%)。从融资规模来看, 上一交易日沪深两市融资买入额为 530.75 亿元(-5.44%), 融资偿还额为 518.98 亿元(-3.46%)。
- 上一交易日, 市场指数中小板指(+0.55%)表现最好, 创业板指(-0.47%)表现最弱; 从行业来看, 有色金属(+2.61%)、食品饮料(+2.15%)、钢铁(+1.93%)、采掘(+1.06%)、综合(+0.97%)等行业表现较好, 国防军工(-0.97%)、计算机(-0.89%)、非银金融(-0.82%)、传媒(-0.62%)、纺织服装(-0.42%)等行业表现较弱。
- 两融标的股票中, 涨幅前五名为: 中远海控(+10.08%)、山西焦化(+10.04%)、杉杉股份(+10.02%)、万达信息(+10.01%)和方大炭素(+10.01%); 跌幅前五名为: 美尔雅(-9.13%)、济川药业(-3.87%)、蒙草生态(-3.7%)、掌趣科技(-3.59%)和华远地产(-3.48%); 五日量比前五名为: 市北高新(12.73)、九芝堂(9.55)、史丹利(6.63)、万达信息(6.32)和济川药业(4.45)。
- 上一交易日, 发生大宗交易的标的股票有大华股份、世联行、万邦达等 10 只。
- 今日共有 45 只标的股票停牌, 其中今日开始停牌股票有方大炭素、南京银行等 2 只, 今日无复牌股票。
- 今日披露, 大股东增持标的股票有新洋丰、华闻传媒、康得新等 4 只, 大股东减持标的股票有亚厦股份等 4 只。
- 今日披露, 共有 2 只标的股票涉及增发事件, 其中露天煤业等 1 只发布董事会预案, 浙富控股等 1 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 17 只标的股票涉及分红送转事件, 其中有新希望、中国中铁、健康元等 3 只为实施公告日, 比亚迪、天地科技、紫金矿业等 12 只为股权登记日, 特锐德、华电国际等 2 只为除权除息日。
- 今日共有海特高新、苏宁云商、达安基因等 18 只标的股票发布业绩快报, 恩华药业、雷柏科技、博瑞传播等 11 只标的股票发布业绩预告。
- 未来 7 个交易日共有皖江物流、以岭药业、生益科技等 15 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: 中国神华(业绩预增)、东阳光科(业绩预增)。
- 今日拟平仓股票有冠城大通、广汇能源、盛屯矿业等 3 只。
- 上一交易日组合收益率为 0.53%, 至 2017 年 7 月 28 日组合累计收益率为 107.57%, 分别超越上证综指、沪深 300 及创业板指 46.62、32.9 及 70.98 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.....	12
6. 标的股票限售股解禁.....	13
三、事件投资组合操作.....	13
1. 组合历史收益.....	14
2. 今日组合操作.....	14
3. 昨日组合操作回顾.....	15
4. 组合成分股.....	15

图表目录

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

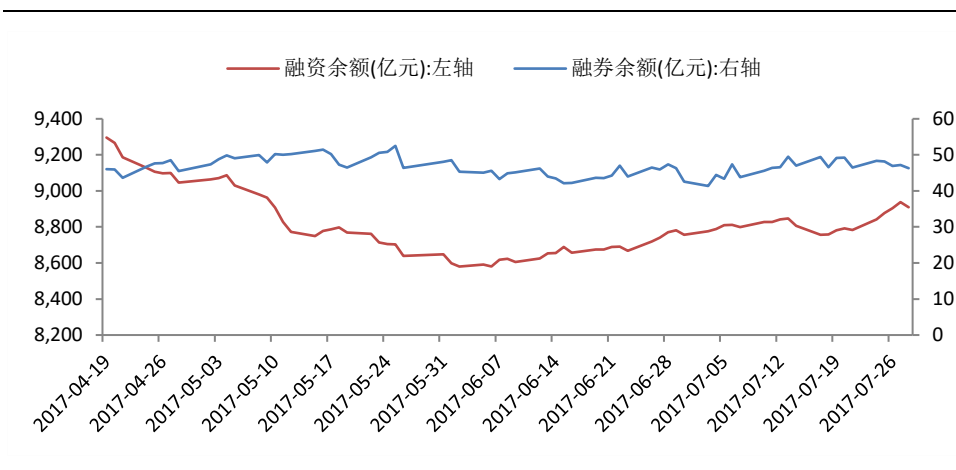
图表 23: 今日拟平仓股票	15
图表 24: 昨日建仓股票	15
图表 25: 昨日平仓股票	15
图表 26: 组合成分股	15

一、上一交易日市场回顾

1. 融资融券规模及主要市场指数表现

上一交易日，沪深两市融资融券余额规模为 8842.08 亿元(+0.13%)，其中融资余额规模为 8792.81 亿元(+0.13%)，融券余额规模为 49.27 亿元(+0.19%)。

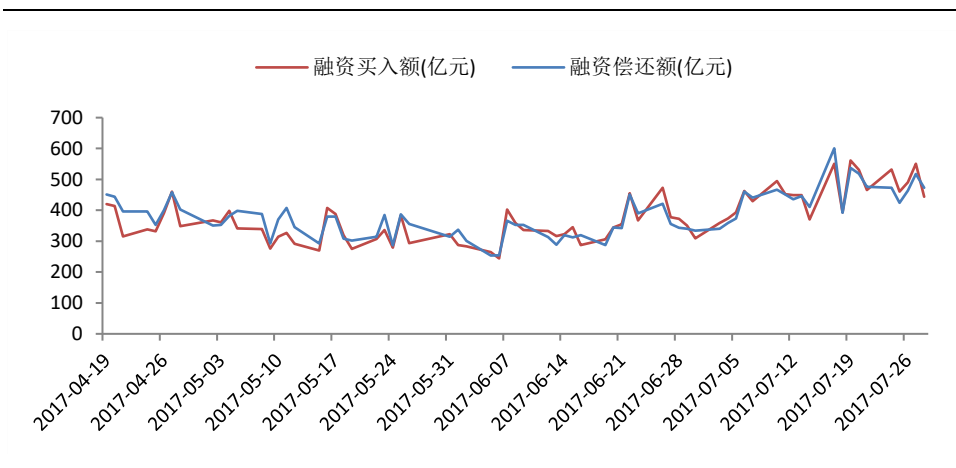
图表 1: 近三月每日融资融券余额规模(亿元)



数据来源: wind, 信达证券研发中心

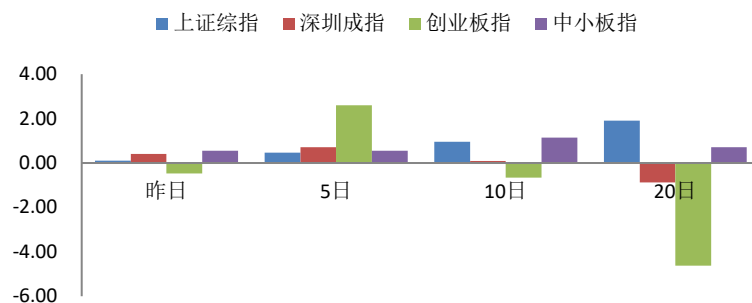
从融资规模来看，上一交易日沪深两市融资买入额为 530.75 亿元(-5.44%)，融资偿还额为 518.98 亿元(-3.46%)。

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 0.55%，创业板指表现最弱，下跌 0.47%；从 5 日涨跌幅看，创业板指表现较好，上涨 2.6%，上证综指表现最弱，上涨 0.47%；从 10 日涨跌幅看，中小板指表现较好，上涨 1.14%，创业板指表现最弱，下跌 0.66%；从 20 日涨跌幅看，上证综指表现较好，上涨 1.9%，创业板指表现最弱，下跌 4.62%。

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, 采掘(+6.54%)、非银金融(+3.89%)、建筑装饰(+2.91%)等行业增速居前, 计算机(-2.09%)、传媒(-2.28%)、食品饮料(-3.69%)等行业增速靠后。

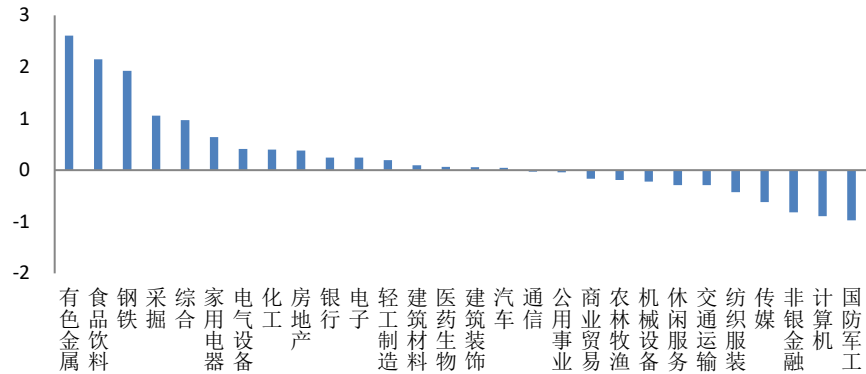
图表 4: 上一交易日两融标的股票分行业融资余额占流通市值比例及增速(%)

序号	代码	行业	融资余额占流通市值比例(%)	占比增速(%)
1	801020.SI	采掘	0.91	6.54
2	801790.SI	非银金融	2.37	3.89
3	801720.SI	建筑装饰	2.23	2.91
4	801040.SI	钢铁	2.33	2.86
5	801180.SI	房地产	3.59	2.86
6	801710.SI	建筑材料	4.11	2.39
7	801170.SI	交通运输	2.05	2.34
8	801030.SI	化工	3.05	1.98
9	801200.SI	商业贸易	5.35	1.94
10	801080.SI	电子	4.96	1.55
11	801110.SI	家用电器	1.95	1.42
12	801050.SI	有色金属	5.11	1.37
13	801210.SI	休闲服务	2.13	0.78
14	801010.SI	农林牧渔	3.55	0.20
15	801150.SI	医药生物	3.07	0.18
16	801230.SI	综合	8.17	0.16
17	801880.SI	汽车	2.49	-0.09
18	801730.SI	电气设备	3.88	-0.27
19	801130.SI	纺织服装	3.35	-0.27
20	801890.SI	机械设备	3.55	-1.11
21	801140.SI	轻工制造	6.03	-1.36
22	801160.SI	公用事业	2.62	-1.44
23	801740.SI	国防军工	3.92	-1.47
24	801770.SI	通信	4.65	-1.58
25	801780.SI	银行	0.81	-1.75
26	801750.SI	计算机	5.72	-2.09
27	801760.SI	传媒	6.69	-2.28
28	801120.SI	食品饮料	1.24	-3.69

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,有色金属(+2.61%)、食品饮料(+2.15%)、钢铁(+1.93%)、采掘(+1.06%)、综合(+0.97%)等行业表现较好,国防军工(-0.97%)、计算机(-0.89%)、非银金融(-0.82%)、传媒(-0.62%)、纺织服装(-0.42%)等行业表现较弱。

图表 5: 申万行业上一交易日涨跌幅(%)

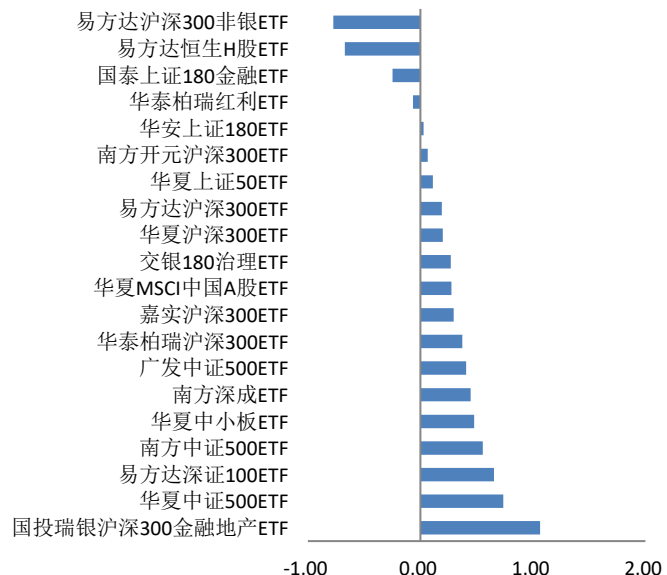


数据来源: wind、信达证券研发中心

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 (+1.06%)、华夏中证 500ETF (+0.74%) 及易方达深证 100ETF (+0.65%); 跌幅前三名为: 易方达沪深 300 非银 ETF (-0.78%)、易方达恒生 H 股 ETF (-0.67%) 及国泰上证 180 金融 ETF (-0.25%)。

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: 中远海控(+10.08%)、山西焦化(+10.04%)、杉杉股份(+10.02%)、万达信息(+10.01%)和方大炭素(+10.01%); 跌幅前五名为: 美尔雅(-9.13%)、济川药业(-3.87%)、蒙草生态(-3.7%)、掌趣科

技 (-3.59%) 和华远地产 (-3.48%)。

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	601919.SH	中远海控	10.08	1.77	600107.SH	美尔雅	-9.13	0.00
2	600740.SH	山西焦化	10.04	2.23	600566.SH	济川药业	-3.87	4.45
3	600884.SH	杉杉股份	10.02	1.54	300355.SZ	蒙草生态	-3.70	0.81
4	300168.SZ	万达信息	10.01	6.32	300315.SZ	掌趣科技	-3.59	1.36
5	600516.SH	方大炭素	10.01	1.06	600743.SH	华远地产	-3.48	1.70
6	000009.SZ	中国宝安	9.99	2.79	002230.SZ	科大讯飞	-3.44	1.00
7	600604.SH	市北高新	9.96	12.73	600967.SH	北方创业	-3.14	0.51
8	000596.SZ	古井贡酒	9.42	3.26	600874.SH	创业环保	-3.10	0.71
9	002460.SZ	赣锋锂业	8.84	1.10	300027.SZ	华谊兄弟	-3.10	1.29
10	000970.SZ	中科三环	8.63	2.83	600728.SH	佳都科技	-3.04	0.55
11	000709.SZ	河钢股份	8.23	1.99	300226.SZ	上海钢联	-2.98	1.46
12	600392.SH	盛和资源	8.12	1.69	600756.SH	浪潮软件	-2.84	1.24
13	600111.SH	北方稀土	7.43	1.39	000540.SZ	中天金融	-2.84	0.71
14	600563.SH	法拉电子	7.24	1.50	600020.SH	中原高速	-2.83	0.71
15	002161.SZ	远望谷	6.82	1.48	300065.SZ	海兰信	-2.78	0.94
16	600503.SH	华丽家族	6.42	1.17	300010.SZ	立思辰	-2.64	1.04
17	600702.SH	沱牌舍得	6.41	1.96	600919.SH	江苏银行	-2.55	1.72
18	603993.SH	洛阳钼业	6.21	1.12	600855.SH	航天长峰	-2.54	0.80
19	000989.SZ	九芝堂	6.18	9.55	002292.SZ	奥飞娱乐	-2.51	1.20
20	000413.SZ	东旭光电	5.90	2.38	600633.SH	浙数文化	-2.50	0.86

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: 市北高新 (12.73)、九芝堂 (9.55)、史丹利 (6.63)、万达信息 (6.32) 和济川药业 (4.45)。

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	600604.SH	市北高新	9.96	12.73
2	000989.SZ	九芝堂	6.18	9.55
3	002588.SZ	史丹利	3.30	6.63
4	300168.SZ	万达信息	10.01	6.32
5	600566.SH	济川药业	-3.87	4.45
6	600831.SH	广电网络	4.45	4.25
7	000848.SZ	承德露露	3.06	3.91
8	002148.SZ	北纬通信	3.96	3.63
9	600730.SH	中国高科	3.11	3.36
10	000596.SZ	古井贡酒	9.42	3.26
11	000559.SZ	万向钱潮	3.06	3.00
12	300133.SZ	华策影视	1.92	2.95
13	600059.SH	古越龙山	1.76	2.88
14	002071.SZ	长城影视	2.93	2.85

15	000970.SZ	中科三环	8.63	2.83
16	600197.SH	伊力特	5.74	2.80
17	000009.SZ	中国宝安	9.99	2.79
18	600330.SH	天通股份	5.59	2.59
19	002646.SZ	青青稞酒	2.12	2.42
20	600880.SH	博瑞传播	2.90	2.41

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: 本钢板材(47.01%)、博瑞传播(41.76%)、大华股份(38.52%)、长江电力(35.01%)、国药一致(34.66%)。

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	000761.SZ	本钢板材	3.37	47.01	39.35
2	600880.SH	博瑞传播	2.90	41.76	44.37
3	002236.SZ	大华股份	3.00	38.52	236.71
4	600900.SH	长江电力	2.07	35.01	97.92
5	000028.SZ	国药一致	0.26	34.66	22.23
6	002304.SZ	洋河股份	5.22	34.24	212.28
7	600978.SH	宜华生活	0.51	34.20	34.11
8	000568.SZ	泸州老窖	4.41	33.80	190.94
9	000860.SZ	顺鑫农业	2.76	32.79	66.36
10	600557.SH	康缘药业	0.31	32.57	9.26
11	601155.SH	新城控股	2.39	32.32	73.48
12	600261.SH	阳光照明	1.09	32.23	14.17
13	600777.SH	新潮能源	1.89	31.32	32.09
14	600702.SH	沱牌舍得	6.41	31.03	195.58
15	600568.SH	中珠医疗	4.81	30.98	148.27
16	600138.SH	中青旅	1.17	30.45	20.04
17	600010.SH	宝钢股份	2.00	30.33	274.45
18	002202.SZ	金风科技	1.71	30.32	41.19
19	600307.SH	酒钢宏兴	2.60	30.16	159.53
20	000883.SZ	湖北能源	1.62	30.09	31.14

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: 王府井(22.26%)、人福医药(16.04%)、哈药股份(14.2%)、金地集团(11.6%)、恒瑞医药(9.98%); 尾盘金额流入率最高的前五名是: 博瑞传播(23.34%)、大众公用(23.01%)、本钢板材(19.9%)、重庆啤酒(17.1%)、大北农(16.46%)。

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	600859.SH	王府井	0.70	22.26	11.28	600880.SH	博瑞传播	2.90	23.34	24.80
2	600079.SH	人福医药	1.86	16.04	23.05	600635.SH	大众公用	1.10	23.01	23.87
3	600664.SH	哈药股份	0.18	14.20	9.66	000761.SZ	本钢板材	3.37	19.90	17.11
4	600383.SH	金地集团	0.33	11.60	41.93	600132.SH	重庆啤酒	1.52	17.10	9.58
5	600276.SH	恒瑞医药	0.83	9.98	41.65	002385.SZ	大北农	1.32	16.46	13.62
6	600686.SH	金龙汽车	0.08	9.75	4.21	600568.SH	中珠医疗	4.81	16.21	77.55

7	601877.SH	正泰电器	2.80	9.68	8.15	002067.SZ	景兴纸业	0.63	15.98	32.12
8	601929.SH	吉视传媒	0.00	9.44	4.14	000898.SZ	鞍钢股份	1.66	13.29	19.24
9	600716.SH	凤凰股份	1.00	9.22	5.39	600518.SH	康美药业	0.63	12.78	22.68
10	000538.SZ	云南白药	0.50	8.36	15.13	601238.SH	广汽集团	0.65	12.48	16.71
11	000685.SZ	中山公用	-0.72	8.26	7.32	000501.SZ	鄂武商 A	0.74	12.13	11.12
12	002482.SZ	广田集团	0.91	8.09	5.16	300034.SZ	钢研高纳	-0.13	12.06	8.21
13	600153.SH	建发股份	0.08	8.08	23.56	600160.SH	巨化股份	0.41	11.56	62.20
14	600884.SH	杉杉股份	10.02	7.73	96.68	600220.SH	江苏阳光	0.30	11.32	2.55
15	601225.SH	陕西煤业	2.03	7.61	59.44	600517.SH	置信电气	0.72	11.01	3.59
16	600022.SH	山东钢铁	0.88	7.61	38.22	601166.SH	兴业银行	0.62	10.47	79.80
17	600740.SH	山西焦化	10.04	7.51	53.97	601877.SH	正泰电器	2.80	10.36	8.73
18	002369.SZ	卓翼科技	-0.63	7.42	1.28	000708.SZ	大冶特钢	1.45	10.28	12.81
19	000552.SZ	靖远煤电	2.33	7.40	7.83	600016.SH	民生银行	0.35	10.18	47.97
20	601919.SH	中远海控	10.08	7.26	106.63	600199.SH	金种子酒	4.04	10.17	20.92

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(21.48%)、全柴动力(20.87%)、卓翼科技(20.59%)等,融资余额占流通市值比例增速前十名福建高速(+55.27%)、中原高速(+53.96%)、兖州煤业(+50.88%)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	21.48	600033.SH	福建高速	55.27
2	600218.SH	全柴动力	20.87	600020.SH	中原高速	53.96
3	002369.SZ	卓翼科技	20.59	600188.SH	兖州煤业	50.88
4	300074.SZ	华平股份	20.40	600269.SH	赣粤高速	46.03
5	300216.SZ	千山药机	19.86	600633.SH	浙数文化	45.35
6	300157.SZ	恒泰艾普	19.82	601699.SH	潞安环能	39.04
7	000790.SZ	泰合健康	19.27	600884.SH	杉杉股份	32.33
8	000917.SZ	电广传媒	18.31	002285.SZ	世联行	30.56
9	002476.SZ	宝莫股份	17.69	600755.SH	厦门国贸	26.97
10	600692.SH	亚通股份	17.41	600801.SH	华新水泥	26.64

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大华股份、世联行、万邦达等 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	002236.SZ	大华股份	24.47	23.69	3.29	24.40	9.86	241.27
2	002285.SZ	世联行	9.72	10.80	-10.00	11.01	382.08	3713.82
3	300055.SZ	万邦达	16.99	17.27	-1.62	16.99	24.00	407.76
4	600016.SH	民生银行	9.33	8.50	9.76	8.53	55.30	515.95
5	600298.SH	安琪酵母	21.78	23.80	-8.49	24.09	1648.00	35893.44
6	600568.SH	中珠医疗	6.97	6.65	4.81	6.97	56.00	390.32

7	600958.SH	东方证券	15.82	16.16	-2.10	15.82	25.00	395.50
8	601288.SH	农业银行	3.46	3.72	-6.99	3.72	2054.33	7107.97
9	601318.SH	中国平安	51.89	52.36	-0.90	51.89	9.00	467.01
10	601668.SH	中国建筑	10.28	10.16	1.18	10.28	65.94	677.86

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 45 只标的股票停牌，其中今日开始停牌股票有方大炭素、南京银行等 2 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	600516.SH	方大炭素	停牌	2017-07-31	0	0.00	
2	601009.SH	南京银行	停牌	2017-07-31	0	0.00	
3	601678.SH	滨化股份	停牌	2017-07-28	3	0.11	重要事项未公告
4	600825.SH	新华传媒	停牌	2017-07-26	5	0.29	重要事项未公告
5	000031.SZ	中粮地产	停牌	2017-07-24	7	0.47	重大事项
6	600410.SH	华胜天成	停牌	2017-07-18	13	2.42	重要事项未公告
7	002570.SZ	贝因美	停牌	2017-07-12	19	1.57	拟披露重大事项
8	002701.SZ	奥瑞金	停牌	2017-07-11	20	1.26	拟披露重大事项
9	600209.SH	罗顿发展	停牌	2017-07-11	20	1.26	重大资产重组
10	601999.SH	出版传媒	停牌	2017-07-03	28	1.90	重大资产重组
11	000061.SZ	农产品	停牌	2017-06-28	33	1.94	重大事项
12	000700.SZ	模塑科技	停牌	2017-06-28	33	1.94	重大事项
13	600239.SH	云南城投	停牌	2017-06-26	35	3.02	重大资产重组
14	600654.SH	中安消	停牌	2017-06-07	54	4.87	重大资产重组
15	600795.SH	国电电力	停牌	2017-06-05	56	4.76	重大资产重组
16	601088.SH	中国神华	停牌	2017-06-05	56	4.76	重要事项未公告
17	600193.SH	创兴资源	停牌	2017-06-01	60	4.36	重大资产重组
18	601989.SH	中国重工	停牌	2017-05-31	61	4.60	重大资产重组
19	600460.SH	士兰微	停牌	2017-05-12	80	6.26	重大资产重组
20	000503.SZ	海虹控股	停牌	2017-05-11	81	6.57	重大资产重组
21	600289.SH	亿阳信通	停牌	2017-05-10	82	5.61	重要事项未公告
22	600653.SH	申华控股	停牌	2017-05-08	84	4.84	重大资产重组
23	000099.SZ	中信海直	停牌	2017-05-04	88	3.76	重大资产重组
24	002070.SZ	*ST 众和	停牌	2017-05-02	90	3.12	重大资产重组
25	601872.SH	招商轮船	停牌	2017-05-02	90	3.12	重要事项未公告
26	002399.SZ	海普瑞	停牌	2017-04-28	94	3.21	重大事项
27	600318.SH	新力金融	停牌	2017-04-27	95	3.58	公司申请停牌对相关事项进行核查
28	000506.SZ	中润资源	停牌	2017-04-25	97	3.95	重大资产重组
29	601717.SH	郑煤机	停牌	2017-04-24	98	2.52	重大资产重组
30	002252.SZ	上海莱士	停牌	2017-04-21	101	2.56	重大事项
31	600100.SH	同方股份	停牌	2017-04-21	101	2.56	重大资产重组

32	300104.SZ	乐视网	停牌	2017-04-17	105	0.22	重大资产重组
33	600643.SH	爱建集团	停牌	2017-04-17	105	0.22	重大资产重组
34	600050.SH	中国联通	停牌	2017-04-05	117	0.95	重要事项未公告
35	600609.SH	金杯汽车	停牌	2017-03-20	133	0.49	重大资产重组
36	002128.SZ	露天煤业	停牌	2017-03-17	136	-0.48	重大资产重组
37	600277.SH	亿利洁能	停牌	2017-03-06	147	1.09	重大资产重组
38	600490.SH	鹏欣资源	停牌	2017-02-21	160	0.41	重大资产重组
39	600559.SH	老白干酒	停牌	2017-01-23	189	4.17	重大资产重组
40	600146.SH	商赢环球	停牌	2017-01-05	207	2.99	重大资产重组
41	600485.SH	信威集团	停牌	2016-12-26	217	4.60	重大资产重组
42	600655.SH	豫园商城	停牌	2016-12-20	223	4.33	重大资产重组
43	600673.SH	东阳光科	停牌	2016-11-15	258	1.34	重大资产重组
44	300088.SZ	长信科技	停牌	2016-09-12	322	5.66	重大资产重组
45	002129.SZ	中环股份	停牌	2016-04-25	462	9.93	重大事件

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新洋丰、华闻传媒、康得新等 4 只, 大股东减持标的股票有亚厦股份等 4 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	000902.SZ	新洋丰	2017/7/31	2017/7/28	增持	0.77	0.00		8.96		-0.63
2	000793.SZ	华闻传媒	2017/7/29	2017/7/28	增持	0.06	0.00	8.15	10.90	10.82	-0.65
3	002450.SZ	康得新	2017/7/29	2017/7/28	增持	0.04	0.00	7.58		19.85	1.58
4	002450.SZ	康得新	2017/7/29	2017/7/28	增持	0.10	0.00	23.76	19.81	19.85	1.58
5	601211.SH	国泰君安	2017/7/29	2017/7/28	增持	0.21	0.00	0.85		20.88	-1.00
6	002375.SZ	亚厦股份	2017/7/29	2017/7/27	减持	0.71	100.00	0.00	8.39	8.45	-0.24
7	600298.SH	安琪酵母	2017/7/29	2017/7/28	减持	2.00	100.00	8.51	21.78	24.02	1.22
8	600704.SH	物产中大	2017/7/29	2017/7/28	减持	0.01	0.00	0.01	7.64	7.64	3.65
9	601225.SH	陕西煤业	2017/7/29	2017/6/21	减持	1.00	0.00	5.27	6.51	6.54	2.03

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 2 只标的股票涉及增发事件, 其中露天煤业等 1 只发布董事会预案, 浙富控股等 1 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	002266.SZ	浙富控股	2017-07-29	股东大会通过		定向	4.71	0.00
2	002128.SZ	露天煤业	2017-07-29	董事会预案	7.75	定向	8.70	0.00

数据来源: wind、信达证券研发中心

4. 标的股票分红送转

今日披露，共有 17 只标的股票涉及分红送转事件，其中有新希望、中国中铁、健康元等 3 只为实施公告日，比亚迪、天地科技、紫金矿业等 12 只为股权登记日，特锐德、华电国际等 2 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	000876.SZ	新希望	2017/7/31	是	0.50	实施公告日	8.23	0.61	6.08	
2	601390.SH	中国中铁	2017/7/31	是	0.09	实施公告日	8.86	0.00	0.99	
3	600380.SH	健康元	2017/7/29	是	0.16	实施公告日	8.95	-1.10	1.79	
4	002594.SZ	比亚迪	2017/8/3	是	0.18	股权登记日	49.47	0.75	0.36	
5	600582.SH	天地科技	2017/8/3	是	0.03	股权登记日	5.02	1.21	0.60	
6	601899.SH	紫金矿业	2017/8/3	是	0.06	股权登记日	3.65	-0.27	1.64	
7	600827.SH	百联股份	2017/8/2	是	0.18	股权登记日	14.79	-0.54	1.22	
8	600958.SH	东方证券	2017/8/1	是	0.15	股权登记日	15.82	-2.10	0.95	
9	601377.SH	兴业证券	2017/8/1	是	0.15	股权登记日	8.09	0.12	1.85	
10	601601.SH	中国太保	2017/8/1	是	0.70	股权登记日	34.19	-0.49	2.05	
11	000022.SZ	深赤湾 A	2017/7/31	是	0.50	股权登记日	28.14	2.36	1.76	
12	600086.SH	东方金钰	2017/7/31	是	0.02	股权登记日	10.50	-0.10	0.21	
13	600288.SH	大恒科技	2017/7/31	是	0.02	股权登记日	10.40	-1.05	0.20	
14	600651.SH	飞乐音响	2017/7/31	是	0.11	股权登记日	8.93	-0.89	1.20	
15	600690.SH	青岛海尔	2017/7/31	是	0.25	股权登记日	14.03	-0.28	1.77	
16	300001.SZ	特锐德	2017/7/31	是	0.02	除权除息日	15.64	-0.32	0.13	
17	600027.SH	华电国际	2017/7/31	是	0.14	除权除息日	4.74	0.00	2.87	

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

今日共有海特高新、苏宁云商、达安基因等 18 只标的股票发布业绩快报，恩华药业、雷柏科技、博瑞传播等 11 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	002262.SZ	恩华药业	三季度预告	略增	30.00	14.04	1.23
2	002577.SZ	雷柏科技	三季度预告	续盈	20.00	21.99	1.81
3	600880.SH	博瑞传播	三季度预告	首亏	0.00	6.39	2.90
4	601933.SH	永辉超市	三季度预告	略增	0.00	6.55	-0.61
5	600096.SH	云天化	半年度预告	续亏	67.20	8.33	0.97
6	600176.SH	中国巨石	半年度预告	略增	30.00	10.66	0.00
7	600259.SH	广晟有色	半年度预告	续亏	67.29	50.67	4.54
8	600376.SH	首开股份	半年度预告	预减	-66.00	11.48	0.09
9	600673.SH	东阳光科	半年度预告	预增	490.00	7.29	0.00
10	601038.SH	一拖股份	半年度预告	预减	-90.00	9.63	1.69
11	601088.SH	中国神华	半年度预告	预增	147.00	19.32	0.00
12	002023.SZ	海特高新	半年度快报		-53.19	9.84	-1.30
13	002024.SZ	苏宁云商	半年度快报		-251.58	10.82	0.65

14	002030.SZ	达安基因	半年度快报		3.69	20.03	0.15
15	002055.SZ	得润电子	半年度快报		137.36	21.99	-0.95
16	002056.SZ	横店东磁	半年度快报		6.00	9.55	4.60
17	002073.SZ	软控股份	半年度快报		1444.00	8.91	-1.87
18	002140.SZ	东华科技	半年度快报		15.46	12.41	-0.72
19	002179.SZ	中航光电	半年度快报		10.69	34.34	-1.21
20	002237.SZ	恒邦股份	半年度快报		68.68	11.11	-0.89
21	002252.SZ	上海莱士	半年度快报		4.97	20.24	0.00
22	002378.SZ	章源钨业	半年度快报		-180.95	10.62	1.72
23	002399.SZ	海普瑞	半年度快报		-101.01	20.23	0.00
24	002410.SZ	广联达	半年度快报		30.24	17.10	-1.21
25	002431.SZ	棕榈股份	半年度快报		97.78	9.54	-0.52
26	002573.SZ	清新环境	半年度快报		17.96	17.22	-0.17
27	002736.SZ	国信证券	半年度快报		-12.11	14.24	-0.07
28	600549.SH	厦门钨业	半年度快报		388.70	27.73	5.28
29	601231.SH	环旭电子	半年度快报		115.97	14.39	3.38

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个交易日共有皖江物流、以岭药业、生益科技等15只标的股票涉及限售股解禁。

图表 18: 未来七个交易日标的股票限售解禁

序号	股票代码	股票简称	解禁时间	解禁数量(万股)	占解禁前A股流通股比	流通股份类型	前收盘价	前涨跌幅(%)
1	600575.SH	皖江物流	2017/7/31	44871.79	11.48	80.52437326	3.97	0.00
2	002603.SZ	以岭药业	2017/7/31	2.88	0.00	75.68998865	16.46	-0.42
3	600183.SH	生益科技	2017/7/31	97.63	0.07	100	14.87	-1.39
4	000783.SZ	长江证券	2017/8/1	78700.00	14.23	99.99863522	9.49	-1.35
5	600518.SH	康美药业	2017/8/1	576.30	0.12	89.01192896	20.63	0.63
6	300355.SZ	蒙草生态	2017/8/1	7579.97	4.72	72.21250295	11.18	-3.70
7	601668.SH	中国建筑	2017/8/2	4501.77	0.15	99.10567772	10.28	1.18
8	600919.SH	江苏银行	2017/8/2	464039.29	40.20	50.19591972	9.17	-2.55
9	600185.SH	格力地产	2017/8/3	44247.79	21.48	100	6.43	-0.31
10	600624.SH	复旦复华	2017/8/4	10140.00	14.81	100	7.12	-0.84
11	000166.SZ	申万宏源	2017/8/4	109.31	0.01	36.66463488	5.87	-0.51
12	000623.SZ	吉林敖东	2017/8/4	2325.54	2.00	94.2163254	23.05	0.35
13	000166.SZ	申万宏源	2017/8/8	80.95	0.00	36.66322058	5.87	-0.51
14	300104.SZ	乐视网	2017/8/8	10664.30	5.35	69.13659945	30.68	0.00
15	601901.SH	方正证券	2017/8/8	194225.09	23.59	100	8.87	-1.11

数据来源: wind、信达证券研发中心

三、事件投资组合操作

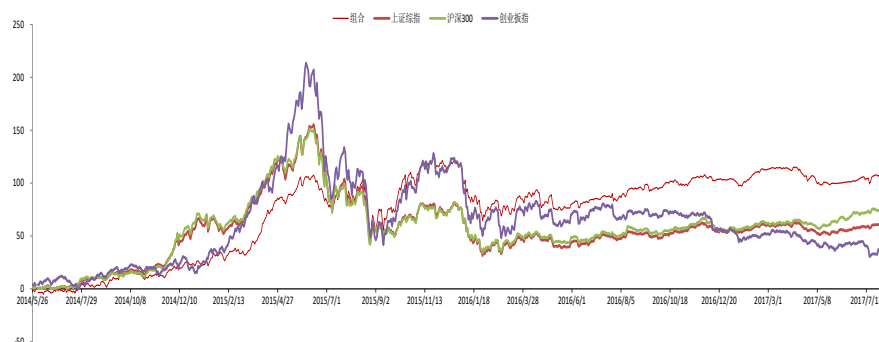
说明: 本事件投资组合是由信达证券事件选股模型针对本报告第一、第二部分事件内容筛选而形成。组合单只股票权重按总资产3%计, 开始日期为2014年5月23日, 不考虑交易费用, 每日盘前制定当日投资操作, 股票买入与卖出的价格按当日均价

执行。

1. 组合历史收益

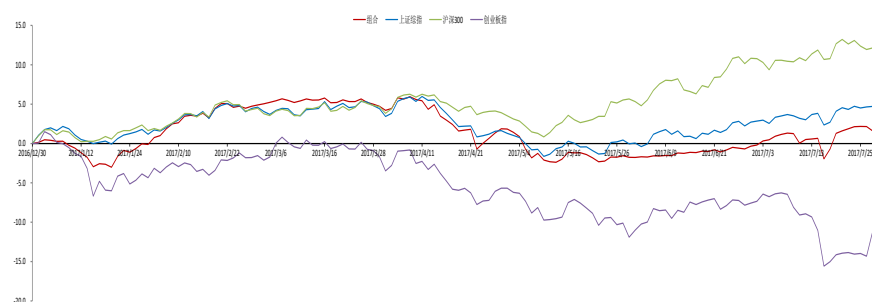
上一交易日组合收益率为 0.53%，至 2017 年 7 月 28 日组合累计收益率为 107.57%，分别超越上证综指、沪深 300 及创业板指 46.62、32.9 及 70.98 个百分点。

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	0.27	2.84	0.78	2.17	9.17	2.14
上证综指	0.26	1.94	3.58	3.29	7.87	4.82
沪深 300	-0.69	1.28	8.03	10.25	15.20	12.44
创业板指	2.69	-4.72	-4.75	-7.30	-22.79	-11.62

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：中国神华(业绩预增)、东阳光科(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	601088.SH	中国神华	3.00	0.00	业绩预增
2	600673.SH	东阳光科	3.00	0.00	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

今日拟平仓股票有冠城大通、广汇能源、盛屯矿业等 3 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	600067.SH	冠城大通	2017/6/30	3.00	12.59
2	600256.SH	广汇能源	2017/7/3	3.00	2.39
3	600711.SH	盛屯矿业	2017/7/4	3.00	7.87

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 7 月 28 日收盘, 组合共有成分股 27 只, 仓位 81.01%。

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	8.24	-7.62	-15.92
2	600067.SH	冠城大通	2017/6/30	6.91	3.00	7.78	12.59	10.55
3	600256.SH	广汇能源	2017/7/3	4.18	3.00	4.28	2.39	0.49
4	600711.SH	盛屯矿业	2017/7/4	6.99	3.00	7.54	7.87	6.07
5	600110.SH	诺德股份	2017/7/5	14.55	3.00	15.39	5.77	3.56
6	601678.SH	滨化股份	2017/7/6	7.30	3.00	8.38	14.83	13.39
7	601006.SH	大秦铁路	2017/7/7	8.68	3.00	8.79	1.23	-0.04
8	600307.SH	酒钢宏兴	2017/7/10	3.06	3.00	3.16	3.22	2.12
9	600893.SH	中航动力	2017/7/10	28.34	3.00	29.22	3.11	2.01
10	000049.SZ	德赛电池	2017/7/11	53.12	3.00	53.70	1.10	-0.17
11	600410.SH	华胜天成	2017/7/11	9.25	3.00	8.26	-10.72	-11.98
12	000988.SZ	华工科技	2017/7/12	14.95	3.00	15.08	0.90	-0.67
13	000006.SZ	深振业 A	2017/7/13	8.56	3.00	8.50	-0.75	-2.49
14	000552.SZ	靖远煤电	2017/7/13	3.72	3.00	3.96	6.46	4.72
15	600511.SH	国药股份	2017/7/13	32.13	3.00	31.01	-3.49	-5.23
16	000528.SZ	柳工	2017/7/14	8.99	3.00	9.19	2.22	1.13

17	000758.SZ	中色股份	2017/7/14	7.68	3.00	8.14	5.94	4.85
18	600872.SH	中炬高新	2017/7/14	18.25	3.00	18.46	1.13	0.04
19	000062.SZ	深圳华强	2017/7/17	24.44	3.00	25.80	5.55	4.59
20	600161.SH	天坛生物	2017/7/17	31.06	3.00	31.24	0.56	-0.39
21	600348.SH	阳泉煤业	2017/7/18	7.61	3.00	7.82	2.75	0.34
22	600141.SH	兴发集团	2017/7/19	13.21	3.00	14.89	12.75	10.69
23	600500.SH	中化国际	2017/7/19	10.09	3.00	10.38	2.87	0.81
24	600491.SH	龙元建设	2017/7/20	10.14	3.00	9.92	-2.12	-2.81
25	601666.SH	平煤股份	2017/7/20	6.79	3.00	6.33	-6.71	-7.40
26	600502.SH	安徽水利	2017/7/21	7.52	3.00	7.66	1.92	1.66
27	600702.SH	沱牌舍得	2017/7/21	27.48	3.00	29.89	8.78	8.52

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	易耀华	0755-82497333	18680307697	yiyaohua@cindasc.com
国际	唐 蕾	010-63080945	18610350427	tanglei@cindasc.com