

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8月1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 8954.79 亿元(-0.33%), 其中融资余额规模为 8908.47 亿元(-0.33%), 融券余额规模为 46.32 亿元(-1.79%)。从融资规模来看, 上一交易日沪深两市融资买入额为 443.79 亿元(-19.47%), 融资偿还额为 472.93 亿元(-8.56%)。
- 上一交易日, 市场指数中中小板指(+0.85%)表现最好, 创业板指(+0.13%)表现最弱; 从行业来看, 钢铁(+4.72%)、有色金属(+4.19%)、采掘(+3.17%)、化工(+1.92%)、商业贸易(+1.62%)等行业表现较好, 国防军工(-1.08%)、银行(-0.33%)、休闲服务(-0.11%)、家用电器(-0.08%)、公用事业(+0.02%)等行业表现较弱。
- 两融标的股票中, 涨幅前五名为: 包钢股份(+10.2%)、金岭矿业(+10.06%)、昊华能源(+10.04%)、盛和资源(+10.01%)和兴发集团(+10.01%); 跌幅前五名为: 一拖股份(-6.75%)、美尔雅(-5.18%)、北方创业(-4.18%)、光正集团(-3.23%)和三聚环保(-3.07%); 五日量比前五名为: 南京高科(6.22)、航民股份(5.58)、广东明珠(5.55)、苏宁云商(4.74)和鞍钢股份(4.34)。
- 上一交易日, 发生大宗交易的标的股票有泸州老窖、温氏股份、上海机场等 5 只。
- 今日共有 45 只标的股票停牌, 其中今日开始停牌股票有江山股份、西部矿业等 2 只, 今日复牌股票有滨化股份、华胜天成等 2 只。
- 今日披露, 无大股东增持标的股票, 大股东减持标的股票有世联行等 2 只。
- 今日披露, 共有 2 只标的股票涉及增发事件, 其中爱建集团等 1 只发布董事会预案, TCL 集团等 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, 其中有华孚色纺、华泰证券等 2 只实施公告日, 新希望、比亚迪、健康元等 10 只为股权登记日, 深赤湾 A、东方金钰、大恒科技等 5 只为除权除息日。
- 今日共有诺德股份等 1 只标的股票发布业绩预告。
- 未来 7 个交易日共有长江证券、康美药业、蒙草生态等 12 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: 诺德股份(业绩预增)。
- 今日拟平仓股票有诺德股份等 1 只。
- 上一交易日组合收益率为 1.79%, 至 2017 年 7 月 31 日组合累计收益率为 111.29%, 分别超越上证综指、沪深 300 及创业板指 49.36、35.87 及 74.52 个百分点。

目录

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

图表目录

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

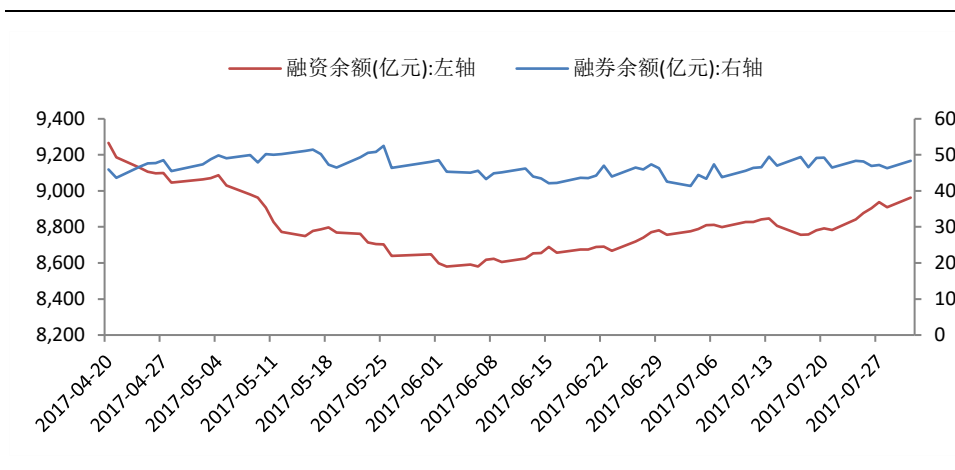
图表 23: 今日拟平仓股票	14
图表 24: 昨日建仓股票	14
图表 25: 昨日平仓股票	14
图表 26: 组合成分股	14

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 8954.79 亿元(-0.33%)，其中融资余额规模为 8908.47 亿元(-0.33%)，融券余额规模为 46.32 亿元(-1.79%)。

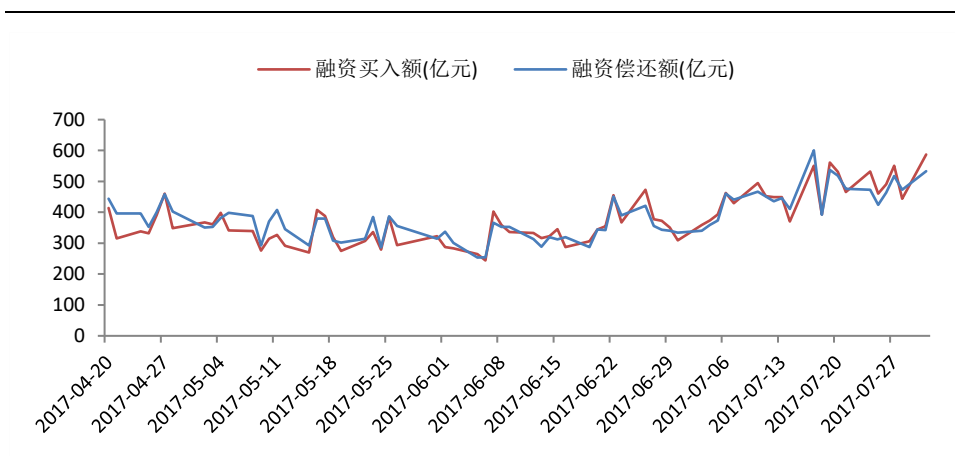
图表 1: 近三月每日融资融券余额规模 (亿元)



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 443.79 亿元(-19.47%)，融资偿还额为 472.93 亿元(-8.56%)。

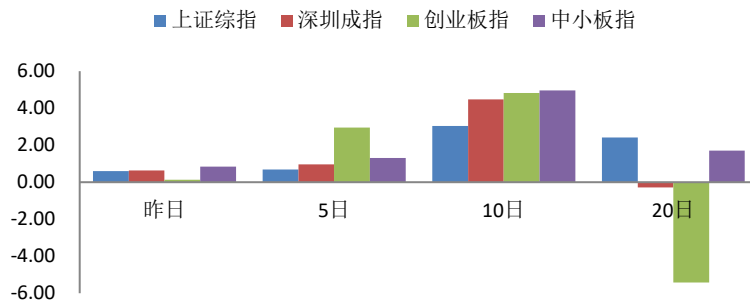
图表 2: 近三月每日融资买入额及偿还额 (亿元)



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 0.85%，创业板指表现最弱，上涨 0.13%；从 5 日涨跌幅看，创业板指表现较好，上涨 2.96%，上证综指表现最弱，上涨 0.69%；从 10 日涨跌幅看，中小板指表现较好，上涨 4.96%，上证综指表现最弱，上涨 3.04%；从 20 日涨跌幅看，上证综指表现较好，上涨 2.41%，创业板指表现最弱，下跌 5.43%。

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, 家用电器(+1.61%)、休闲服务(+1.25%)、银行(+1.2%)等行业增速居前, 商业贸易(-2.06%)、综合(-2.46%)、有色金属(-3.04%)等行业增速靠后。

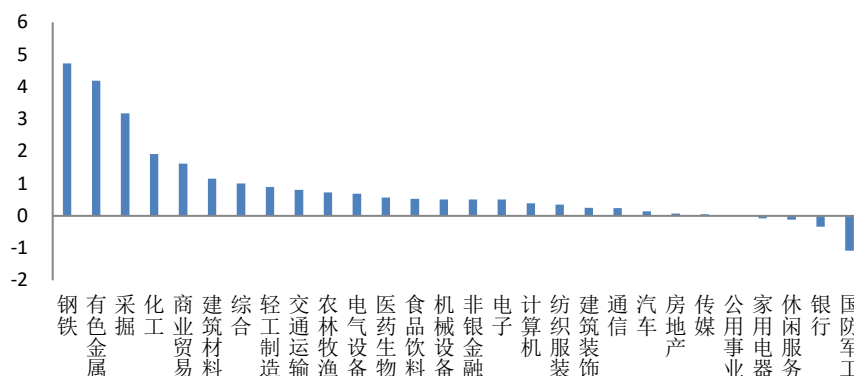
图表 4: 上一交易日两融标的股票分行业融资余额占流通市值比例及增速(%)

序号	代码	行业	融资余额占流通市值比例(%)	占比增速(%)
1	801110.SI	家用电器	1.98	1.61
2	801210.SI	休闲服务	2.16	1.25
3	801780.SI	银行	0.82	1.20
4	801790.SI	非银金融	2.39	1.03
5	801740.SI	国防军工	3.96	0.98
6	801880.SI	汽车	2.51	0.87
7	801160.SI	公用事业	2.64	0.51
8	801180.SI	房地产	3.61	0.48
9	801130.SI	纺织服装	3.36	0.31
10	801770.SI	通信	4.66	0.25
11	801720.SI	建筑装饰	2.24	0.13
12	801010.SI	农林牧渔	3.55	-0.02
13	801170.SI	交通运输	2.05	-0.08
14	801080.SI	电子	4.95	-0.20
15	801750.SI	计算机	5.70	-0.22
16	801120.SI	食品饮料	1.24	-0.27
17	801730.SI	电气设备	3.86	-0.40
18	801020.SI	采掘	0.90	-0.45
19	801760.SI	传媒	6.65	-0.47
20	801150.SI	医药生物	3.06	-0.50
21	801890.SI	机械设备	3.53	-0.71
22	801030.SI	化工	3.03	-0.75
23	801710.SI	建筑材料	4.06	-1.18
24	801140.SI	轻工制造	5.92	-1.78
25	801040.SI	钢铁	2.29	-1.90
26	801200.SI	商业贸易	5.24	-2.06
27	801230.SI	综合	7.97	-2.46
28	801050.SI	有色金属	4.96	-3.04

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,钢铁(+4.72%)、有色金属(+4.19%)、采掘(+3.17%)、化工(+1.92%)、商业贸易(+1.62%)等行业表现较好,国防军工(-1.08%)、银行(-0.33%)、休闲服务(-0.11%)、家用电器(-0.08%)、公用事业(+0.02%)等行业表现较弱。

图表 5: 申万行业上一交易日涨跌幅(%)

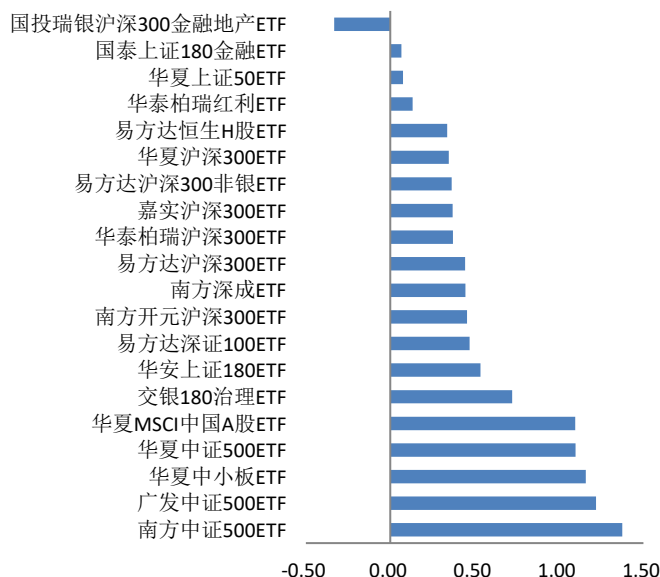


数据来源: wind、信达证券研发中心

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:南方中证 500ETF (+1.38%)、广发中证 500ETF (+1.22%)及华夏中小板 ETF (+1.16%);跌幅前三名为:国投瑞银沪深 300 金融地产 ETF (-0.33%)、国泰上证 180 金融 ETF (+0.07%)及华夏上证 50ETF (+0.07%)。

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:包钢股份(+10.2%)、金岭矿业(+10.06%)、昊华能源(+10.04%)、盛和资源(+10.01%)和兴发集团(+10.01%);跌幅前五名为:一拖股份(-6.75%)、美尔雅(-5.18%)、北方创业(-4.18%)、光正

集团（-3.23%）和三聚环保（-3.07%）。

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	600010.SH	包钢股份	10.20	3.25	601038.SH	一拖股份	-6.75	2.65
2	000655.SZ	金岭矿业	10.06	0.51	600107.SH	美尔雅	-5.18	0.64
3	601101.SH	昊华能源	10.04	1.26	600967.SH	北方创业	-4.18	1.15
4	600392.SH	盛和资源	10.01	1.67	002524.SZ	光正集团	-3.23	0.95
5	600141.SH	兴发集团	10.01	1.64	300072.SZ	三聚环保	-3.07	1.66
6	000807.SZ	云铝股份	10.00	1.80	000793.SZ	华闻传媒	-2.97	1.10
7	600382.SH	广东明珠	9.99	5.55	002294.SZ	信立泰	-2.84	1.46
8	600549.SH	厦门钨业	9.99	2.36	600855.SH	航天长峰	-2.75	0.77
9	600111.SH	北方稀土	9.99	1.44	600466.SH	蓝光发展	-2.62	0.81
10	002024.SZ	苏宁云商	9.98	4.74	600316.SH	洪都航空	-2.55	0.74
11	600604.SH	市北高新	9.97	1.58	600478.SH	科力远	-2.46	1.61
12	601600.SH	中国铝业	9.93	1.68	600568.SH	中珠医疗	-2.44	0.38
13	002161.SZ	远望谷	9.91	1.50	601018.SH	宁波港	-2.40	1.09
14	600389.SH	江山股份	9.75	2.41	300065.SZ	海兰信	-2.38	0.95
15	600309.SH	万华化学	9.55	1.37	600038.SH	中直股份	-2.34	1.26
16	600987.SH	航民股份	9.48	5.58	600435.SH	北方导航	-2.21	1.00
17	000983.SZ	西山煤电	9.10	1.79	000400.SZ	许继电气	-2.14	2.54
18	600064.SH	南京高科	9.01	6.22	002368.SZ	太极股份	-2.02	1.75
19	600971.SH	恒源煤电	8.46	1.38	002571.SZ	德力股份	-1.99	1.00
20	002340.SZ	格林美	8.39	1.32	600135.SH	乐凯胶片	-1.99	0.68

数据来源：wind、信达证券研发中心

上一交易日，标的股票五日量比前五名为：南京高科（6.22）、航民股份（5.58）、广东明珠（5.55）、苏宁云商（4.74）和鞍钢股份（4.34）。

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	600064.SH	南京高科	9.01	6.22
2	600987.SH	航民股份	9.48	5.58
3	600382.SH	广东明珠	9.99	5.55
4	002024.SZ	苏宁云商	9.98	4.74
5	000898.SZ	鞍钢股份	2.61	4.34
6	600059.SH	古越龙山	3.56	4.12
7	002028.SZ	思源电气	0.06	3.43
8	600663.SH	陆家嘴	3.64	3.30
9	600010.SH	包钢股份	10.20	3.25
10	000761.SZ	本钢板材	2.92	3.11
11	600216.SH	浙江医药	4.44	3.01
12	601388.SH	怡球资源	7.86	2.88
13	600543.SH	莫高股份	1.49	2.87
14	002067.SZ	景兴纸业	2.35	2.72

15	600197.SH	伊力特	5.54	2.72
16	600699.SH	均胜电子	2.75	2.69
17	601038.SH	一拖股份	-6.75	2.65
18	002001.SZ	新和成	5.68	2.63
19	600740.SH	山西焦化	7.49	2.63
20	600498.SH	烽火通信	2.90	2.62

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: 美好置业(50.98%)、徐工机械(38.62%)、浙富控股(36.59%)、金风科技(36.55%)、洽洽食品(36.02%)。

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	000667.SZ	美好置业	1.51	50.98	50.82
2	000425.SZ	徐工机械	2.55	38.62	143.62
3	002266.SZ	浙富控股	3.40	36.59	30.97
4	002202.SZ	金风科技	2.21	36.55	62.32
5	002557.SZ	洽洽食品	2.25	36.02	12.38
6	000157.SZ	中联重科	2.35	35.26	93.25
7	600022.SH	山东钢铁	3.95	34.51	302.97
8	600219.SH	南山铝业	5.16	34.36	344.75
9	601933.SH	永辉超市	4.27	34.19	229.10
10	002493.SZ	荣盛石化	3.18	34.03	67.46
11	002408.SZ	齐翔腾达	3.13	33.84	77.42
12	002299.SZ	圣农发展	7.83	32.95	136.01
13	600720.SH	祁连山	3.81	32.72	148.12
14	600056.SH	中国医药	0.50	32.65	25.74
15	600859.SH	王府井	2.15	31.22	31.16
16	600664.SH	哈药股份	1.79	31.00	31.79
17	601929.SH	吉视传媒	0.88	30.64	15.01
18	000630.SZ	铜陵有色	3.53	30.07	356.72
19	601238.SH	广汽集团	1.19	29.92	55.67
20	000825.SZ	太钢不锈	3.77	29.91	174.98

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(3.81%)、人福医药(0%)、哈药股份(0%)、金地集团(0%)、恒瑞医药(0%); 尾盘金额流入率最高的前五名是: 丹化科技(22.57%)、深高速(22.42%)、齐翔腾达(17.29%)、奋达科技(16.55%)、烟台冰轮(14.86%)。

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	2.15	3.81	3.81	600844.SH	丹化科技	0.58	22.57	2.83
2	600079.SH	人福医药	-0.05	0.00	0.00	600548.SH	深高速	2.20	22.42	15.18
3	600664.SH	哈药股份	1.79	0.00	0.00	002408.SZ	齐翔腾达	3.13	17.29	39.56
4	600383.SH	金地集团	-0.99	0.00	0.00	002681.SZ	奋达科技	2.18	16.55	9.86
5	600276.SH	恒瑞医药	0.61	0.00	0.00	000811.SZ	烟台冰轮	2.01	14.86	17.91
6	600686.SH	金龙汽车	0.48	0.00	0.00	000939.SZ	凯迪生态	0.77	14.66	7.64

7	601877.SH	正泰电器	-0.81	0.00	0.00	002140.SZ	东华科技	1.29	14.36	7.45
8	601929.SH	吉视传媒	0.88	0.00	0.00	002266.SZ	浙富控股	3.40	14.35	12.14
9	600716.SH	凤凰股份	0.00	0.00	0.00	000823.SZ	超声电子	3.57	14.34	20.61
10	000538.SZ	云南白药	-0.69	0.00	0.00	601118.SH	海南橡胶	2.79	13.44	37.06
11	000685.SZ	中山公用	1.37	0.00	0.00	600894.SH	广日股份	0.93	13.26	7.15
12	002482.SZ	广田集团	0.34	0.00	0.00	600261.SH	阳光照明	1.84	13.24	9.06
13	600153.SH	建发股份	2.97	0.00	0.00	002344.SZ	海宁皮城	0.50	13.16	4.49
14	600884.SH	杉杉股份	6.25	0.00	0.00	000961.SZ	中南建设	0.49	13.12	5.82
15	601225.SH	陕西煤业	4.22	0.00	0.00	600418.SH	江淮汽车	-0.49	12.99	16.72
16	600022.SH	山东钢铁	3.95	0.00	0.00	300147.SZ	香雪制药	1.14	12.67	4.37
17	600740.SH	山西焦化	7.49	0.00	0.00	600895.SH	张江高科	1.02	12.45	15.38
18	002369.SZ	卓翼科技	0.13	0.00	0.00	600333.SH	长春燃气	0.72	12.21	3.83
19	000552.SZ	靖远煤电	2.53	0.00	0.00	600790.SH	轻纺城	0.59	12.19	5.00
20	601919.SH	中远海控	5.67	0.00	0.00	000528.SZ	柳工	0.65	12.03	40.58

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(21.49%)、全柴动力(20.76%)、卓翼科技(20.6%)等,融资余额占流通市值比例增速前十名为本钢板材(+17.84%)、宁波港(+13.14%)、新华保险(+10.81%)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	21.49	000761.SZ	本钢板材	17.84
2	600218.SH	全柴动力	20.76	601018.SH	宁波港	13.14
3	002369.SZ	卓翼科技	20.60	601336.SH	新华保险	10.81
4	300074.SZ	华平股份	20.18	600958.SH	东方证券	10.72
5	300157.SZ	恒泰艾普	19.90	000708.SZ	大冶特钢	10.65
6	300216.SZ	千山药机	19.75	601231.SH	环旭电子	9.00
7	000790.SZ	泰合健康	19.23	000418.SZ	小天鹅 A	8.91
8	000917.SZ	电广传媒	18.24	600987.SH	航民股份	8.68
9	600692.SH	亚通股份	17.65	000898.SZ	鞍钢股份	8.20
10	000996.SZ	中国中期	17.42	600107.SH	美尔雅	7.83

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泸州老窖、温氏股份、上海机场等 5 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	000568.SZ	泸州老窖	55.37	55.13	0.44	55.37	28.50	1578.05
2	300498.SZ	温氏股份	18.30	20.33	-9.99	20.22	23.40	428.22
3	600009.SH	上海机场	37.43	36.50	2.55	37.45	26.60	995.64
4	600519.SH	贵州茅台	481.22	483.92	-0.56	481.22	2.10	1010.56
5	601818.SH	光大银行	4.23	4.23	0.00	4.23	590.00	2495.70

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江山股份、西部矿业等 2 只，今日复牌股票有滨化股份、华胜天成等 2 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	601678.SH	滨化股份	复牌	2017-07-28	4	0.72	重要事项未公告
2	600410.SH	华胜天成	复牌	2017-07-18	14	3.04	重要事项未公告
3	600389.SH	江山股份	停牌	2017-08-01	0	0.00	
4	601168.SH	西部矿业	停牌	2017-08-01	0	0.00	
5	600516.SH	方大炭素	停牌	2017-07-31	1	0.61	重要事项未公告
6	601009.SH	南京银行	停牌	2017-07-31	1	0.61	重要事项未公告
7	600825.SH	新华传媒	停牌	2017-07-26	6	0.90	重要事项未公告
8	000031.SZ	中粮地产	停牌	2017-07-24	8	1.08	重大事项
9	002570.SZ	贝因美	停牌	2017-07-12	20	2.19	拟披露重大事项
10	002701.SZ	奥瑞金	停牌	2017-07-11	21	1.88	拟披露重大事项
11	600209.SH	罗顿发展	停牌	2017-07-11	21	1.88	重大资产重组
12	601999.SH	出版传媒	停牌	2017-07-03	29	2.52	重大资产重组
13	000061.SZ	农产品	停牌	2017-06-28	34	2.56	重大事项
14	000700.SZ	模塑科技	停牌	2017-06-28	34	2.56	重大事项
15	600239.SH	云南城投	停牌	2017-06-26	36	3.65	重大资产重组
16	600654.SH	中安消	停牌	2017-06-07	55	5.51	重大资产重组
17	600795.SH	国电电力	停牌	2017-06-05	57	5.39	重大资产重组
18	601088.SH	中国神华	停牌	2017-06-05	57	5.39	重要事项未公告
19	600193.SH	创兴资源	停牌	2017-06-01	61	5.00	重大资产重组
20	601989.SH	中国重工	停牌	2017-05-31	62	5.24	重大资产重组
21	600460.SH	士兰微	停牌	2017-05-12	81	6.91	重大资产重组
22	000503.SZ	海虹控股	停牌	2017-05-11	82	7.21	重大资产重组
23	600289.SH	亿阳信通	停牌	2017-05-10	83	6.25	重要事项未公告
24	600653.SH	中华控股	停牌	2017-05-08	85	5.48	重大资产重组
25	000099.SZ	中信海直	停牌	2017-05-04	89	4.39	重大资产重组
26	002070.SZ	*ST 众和	停牌	2017-05-02	91	3.75	重大资产重组
27	601872.SH	招商轮船	停牌	2017-05-02	91	3.75	重要事项未公告
28	002399.SZ	海普瑞	停牌	2017-04-28	95	3.83	重大事项
29	600318.SH	新力金融	停牌	2017-04-27	96	4.21	公司申请停牌对相关事项进行核查
30	000506.SZ	中润资源	停牌	2017-04-25	98	4.59	重大资产重组
31	601717.SH	郑煤机	停牌	2017-04-24	99	3.15	重大资产重组
32	002252.SZ	上海莱士	停牌	2017-04-21	102	3.18	重大事项
33	600100.SH	同方股份	停牌	2017-04-21	102	3.18	重大资产重组
34	300104.SZ	乐视网	停牌	2017-04-17	106	0.83	重大资产重组
35	600643.SH	爱建集团	停牌	2017-04-17	106	0.83	重大资产重组
36	600050.SH	中国联通	停牌	2017-04-05	118	1.57	重要事项未公告

37	600609.SH	金杯汽车	停牌	2017-03-20	134	1.10	重大资产重组
38	002128.SZ	露天煤业	停牌	2017-03-17	137	0.13	重大资产重组
39	600277.SH	亿利洁能	停牌	2017-03-06	148	1.70	重大资产重组
40	600490.SH	鹏欣资源	停牌	2017-02-21	161	1.02	重大资产重组
41	600559.SH	老白干酒	停牌	2017-01-23	190	4.80	重大资产重组
42	600146.SH	商赢环球	停牌	2017-01-05	208	3.62	重大资产重组
43	600485.SH	信威集团	停牌	2016-12-26	218	5.24	重大资产重组
44	600655.SH	豫园商城	停牌	2016-12-20	224	4.97	重大资产重组
45	600673.SH	东阳光科	停牌	2016-11-15	259	1.95	重大资产重组
46	300088.SZ	长信科技	停牌	2016-09-12	323	6.31	重大资产重组
47	002129.SZ	中环股份	停牌	2016-04-25	463	10.60	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, 无大股东增持标的股票, 大股东减持标的股票有世联行等 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 (%)	变动后持股比例 (%)	交易平均价	变动期间股票均价	前涨跌幅 (%)
1	002285.SZ	世联行	2017/8/1	2017/7/28	减持	0.22	100.00	5.00	9.72	10.98	2.27
2	002285.SZ	世联行	2017/8/1	2016/8/25	减持	0.02	100.00	5.19	8.24	8.47	2.27
3	601258.SH	庞大集团	2017/8/1	2017/7/31	减持	0.01	0.00	0.03	2.77	2.77	0.36
4	601258.SH	庞大集团	2017/8/1	2017/7/28	减持	0.00	0.00	0.01	2.77	2.77	0.36

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, 其中爱建集团等 1 只发布董事会预案, TCL 集团等 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	000100.SZ	TCL 集团	2017-08-01	股东大会通过	3.10	定向	3.67	2.23
2	600643.SH	爱建集团	2017-08-01	董事会预案	9.20	定向	14.98	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, 其中有华孚色纺、华泰证券等 2 只实施公告日, 新希望、比亚迪、健康元等 10 只为股权登记日, 深赤湾 A、东方金钰、大恒科技等 5 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	002042.SZ	华孚色纺	2017/8/1	是	0.05	实施公告日	10.65	0.57	0.45	
2	601688.SH	华泰证券	2017/8/1	是	0.50	实施公告日	19.90	1.22	2.51	

3	000876.SZ	新希望	2017/8/7	是	0.50	股权登记日	8.31	0.97	6.02	
4	002594.SZ	比亚迪	2017/8/3	是	0.18	股权登记日	49.00	-0.95	0.36	
5	600380.SH	健康元	2017/8/3	是	0.16	股权登记日	9.22	3.02	1.74	
6	600582.SH	天地科技	2017/8/3	是	0.03	股权登记日	5.13	2.19	0.58	
7	601390.SH	中国中铁	2017/8/3	是	0.09	股权登记日	8.86	0.00	0.99	
8	601899.SH	紫金矿业	2017/8/3	是	0.06	股权登记日	3.73	2.19	1.61	
9	600827.SH	百联股份	2017/8/2	是	0.18	股权登记日	15.08	1.96	1.19	
10	600958.SH	东方证券	2017/8/1	是	0.15	股权登记日	16.38	3.54	0.92	
11	601377.SH	兴业证券	2017/8/1	是	0.15	股权登记日	8.13	0.49	1.85	
12	601601.SH	中国太保	2017/8/1	是	0.70	股权登记日	34.17	-0.06	2.05	
13	000022.SZ	深赤湾 A	2017/8/1	是	0.50	除权除息日	27.99	-0.53	1.77	
14	600086.SH	东方金钰	2017/8/1	是	0.02	除权除息日	10.51	0.10	0.21	
15	600288.SH	大恒科技	2017/8/1	是	0.02	除权除息日	10.52	1.15	0.20	
16	600651.SH	飞乐音响	2017/8/1	是	0.11	除权除息日	9.12	2.13	1.17	
17	600690.SH	青岛海尔	2017/8/1	是	0.25	除权除息日	14.04	0.07	1.77	

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

今日共有诺德股份等 1 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	600110.SH	诺德股份	三季度预告	预增	0.00	15.88	3.18

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 个交易日共有长江证券、康美药业、蒙草生态等 12 只标的股票涉及限售股解禁。

图表 18: 未来七个交易日的股票限售解禁

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	000783.SZ	长江证券	2017/8/1	78700.00	14.23	99.99863522	9.50	0.11
2	600518.SH	康美药业	2017/8/1	576.30	0.12	89.01192896	20.74	0.53
3	300355.SZ	蒙草生态	2017/8/1	7579.97	4.72	72.21250295	11.21	0.27
4	601668.SH	中国建筑	2017/8/2	4501.77	0.15	99.10567772	10.29	0.10
5	600919.SH	江苏银行	2017/8/2	464039.29	40.20	50.19591972	9.02	-1.64
6	600185.SH	格力地产	2017/8/3	44247.79	21.48	100	6.37	-0.93
7	600624.SH	复旦复华	2017/8/4	10140.00	14.81	100	7.28	2.25
8	000166.SZ	申万宏源	2017/8/4	109.31	0.01	36.66463488	5.91	0.68
9	000623.SZ	吉林敖东	2017/8/4	2325.54	2.00	94.2163254	23.06	0.04
10	000166.SZ	申万宏源	2017/8/8	80.95	0.00	36.66322058	5.91	0.68
11	300104.SZ	乐视网	2017/8/8	10664.30	5.35	69.13659945	30.68	0.00
12	601901.SH	方正证券	2017/8/8	194225.09	23.59	100	8.91	0.45

数据来源: wind、信达证券研发中心

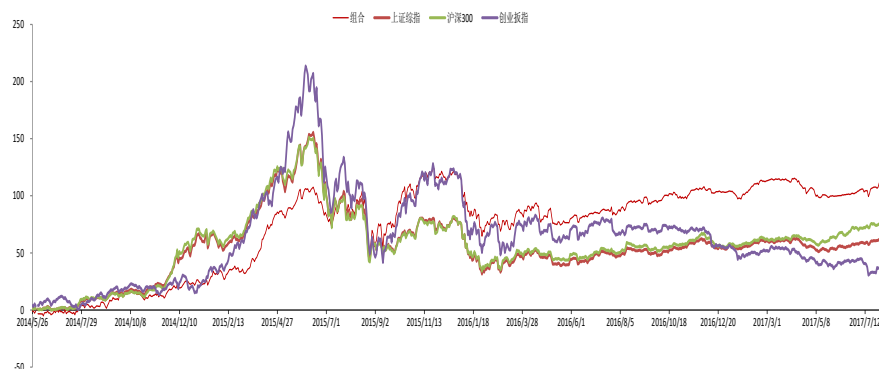
三、事件投资组合操作

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

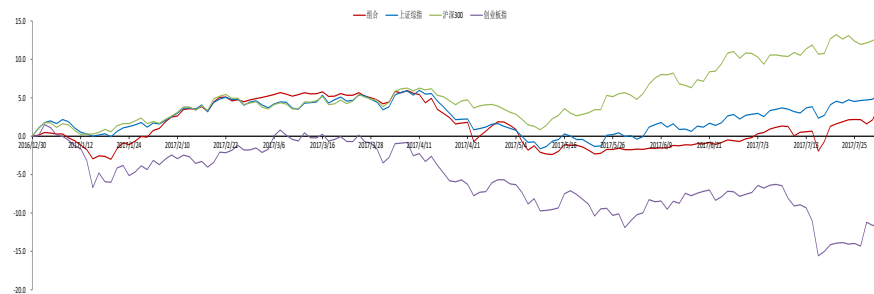
上一交易日组合收益率为 1.79%，至 2017 年 7 月 31 日组合累计收益率为 111.29%，分别超越上证综指、沪深 300 及创业板指 49.36、35.87 及 74.52 个百分点。

图表 19：组合历史收益曲线



数据来源：wind、信达证券研发中心

图表 20：组合今年以来收益曲线



数据来源：wind、信达证券研发中心

图表 21：组合历史收益对比

收益率	近一周%	近一月%	近三月%	近六月%	近一年%	今年以来%
组合	1.79	4.33	2.06	4.09	15.26	3.97
上证综指	1.08	3.15	3.83	3.60	7.31	5.46
沪深 300	0.25	2.52	8.45	10.33	14.32	12.92
创业板指	2.73	-3.98	-5.79	-7.95	-23.83	-11.51

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：诺德股份(业绩预增)。

图表 22: 今日拟建仓股票

序号	股票代码	股票简称	权重(%)	昨日涨幅(%)	建仓理由
1	600110.SH	诺德股份	3.00	3.18	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

今日拟平仓股票有诺德股份等 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	600110.SH	诺德股份	2017/7/5	3.00	9.14

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

昨日平仓股票有冠城大通、广汇能源、盛屯矿业等 3 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	600067.SH	冠城大通	2017/06/30	6.91	3.00	7.79	12.75
2	600256.SH	广汇能源	2017/07/03	4.18	3.00	4.35	4.10
3	600711.SH	盛屯矿业	2017/07/04	6.99	3.00	7.92	13.33

数据来源: wind、信达证券研发中心

4. 组合成分股

至 2017 年 7 月 31 日收盘, 组合共有成分股 24 只, 仓位 72.01%。

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	-16.58
2	600110.SH	诺德股份	2017/7/5	14.55	3.00	15.88	9.14	6.31
3	601678.SH	滨化股份	2017/7/6	7.30	3.00	8.38	14.83	12.77
4	601006.SH	大秦铁路	2017/7/7	8.68	3.00	8.75	0.76	-1.12
5	600307.SH	酒钢宏兴	2017/7/10	3.06	3.00	3.27	6.81	5.10
6	600893.SH	中航动力	2017/7/10	28.34	3.00	28.98	2.26	0.55
7	000049.SZ	德赛电池	2017/7/11	53.12	3.00	54.75	3.07	1.19
8	600410.SH	华胜天成	2017/7/11	9.25	3.00	8.26	-10.72	-12.60
9	000988.SZ	华工科技	2017/7/12	14.95	3.00	15.19	1.64	-0.55
10	000006.SZ	深振业 A	2017/7/13	8.56	3.00	8.51	-0.63	-2.99
11	000552.SZ	靖远煤电	2017/7/13	3.72	3.00	4.06	9.15	6.79
12	600511.SH	国药股份	2017/7/13	32.13	3.00	30.93	-3.74	-6.10

13	000528.SZ	柳工	2017/7/14	8.99	3.00	9.25	2.89	1.18
14	000758.SZ	中色股份	2017/7/14	7.68	3.00	8.52	10.89	9.18
15	600872.SH	中炬高新	2017/7/14	18.25	3.00	19.04	4.30	2.60
16	000062.SZ	深圳华强	2017/7/17	24.44	3.00	25.49	4.28	2.71
17	600161.SH	天坛生物	2017/7/17	31.06	3.00	31.01	-0.18	-1.75
18	600348.SH	阳泉煤业	2017/7/18	7.61	3.00	8.23	8.14	5.10
19	600141.SH	兴发集团	2017/7/19	13.21	3.00	16.38	24.03	21.35
20	600500.SH	中化国际	2017/7/19	10.09	3.00	10.78	6.83	4.15
21	600491.SH	龙元建设	2017/7/20	10.14	3.00	9.85	-2.81	-4.12
22	601666.SH	平煤股份	2017/7/20	6.79	3.00	6.66	-1.85	-3.15
23	600502.SH	安徽水利	2017/7/21	7.52	3.00	7.71	2.58	1.72
24	600702.SH	沱牌舍得	2017/7/21	27.48	3.00	32.01	16.49	15.62

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理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