

## 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

2018年5月11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 9887.95 亿元(+0.23%), 其中融资余额规模为 9828.87 亿元(+0.21%), 融券余额规模为 59.08 亿元(+2.88%)。从融资规模来看, 上一交易日沪深两市融资买入额为 353.13 亿元(+11.85%), 融资偿还额为 332.27 亿元(+14.69%)。
- 上一交易日, 市场指数中创业板指(+0.51%)表现最好, 深证成指(+0.38%)表现最弱; 从行业来看, 医药生物(+2.04%)、休闲服务(+1.52%)、食品饮料(+1.43%)、采掘(+1.14%)、轻工制造(+0.88%)等行业表现较好, 国防军工(-1.12%)、计算机(-0.94%)、电子(-0.06%)、商业贸易(+0.11%)、通信(+0.13%)等行业表现较弱。
- 两融标的股票中, 涨幅前五名为: 世荣兆业(+9.98%)、天坛生物(+7.79%)、古井贡酒(+7.66%)、金牛化工(+6.87%)和恒瑞医药(+6.67%); 跌幅前五名为: 新安股份(-5.95%)、北方华创(-5.23%)、太极股份(-5.08%)、新潮能源(-4.92%)和用友网络(-3.67%); 五日量比前五名为: 金牛化工(7.4)、得润电子(6.66)、宋都股份(6.15)、美克家居(5.82)和天坛生物(4.82)。
- 上一交易日, 发生大宗交易的标的股票有华银电力、辽宁成大、光明乳业等 19 只。
- 今日共有 44 只标的股票停牌, 其中今日开始停牌股票有长园集团等 1 只, 今日无复牌股票。
- 今日披露, 大股东增持标的股票有沃尔核材、齐峰新材、万达信息等 4 只, 大股东减持标的股票有万达信息等 1 只。
- 今日披露, 共有 2 只标的股票涉及增发事件, 其中光迅科技等 1 只发布董事会预案, 华银电力等 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 51 只标的股票涉及分红送转事件, 其中有东旭光电、云南白药、四川九洲等 19 只股东大会通过, 中泰化学、启明星辰、中国巨石等 8 只为实施公告日, 康力电梯、中天金融、华能国际等 18 只为股权登记日, 佛山照明、顺发恒业、万年青等 6 只为除权除息日。
- 今日无标的股票业绩报告发布。
- 未来 7 个交易日共有海大集团、金龙汽车、华数传媒等 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: 徐家汇(分红送转)。
- 今日拟平仓股票有桐昆股份、三峡新材等 2 只。
- 上一交易日组合收益率为 0.31%, 至 2018 年 5 月 10 日组合累计收益率为 124.32%, 分别超越上证综指、沪深 300 及创业板指 67.27、41.62 及 77.38 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.....          | 12 |
| 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.....          | 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.....                  | 12 |
| 图表 16: 未来七个交易日发生分红送转事件标的股票.....            | 12 |
| 图表 17: 今日发布相关业绩报告的标的股票.....                | 13 |
| 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: 组合历史收益对比.....                       | 14 |
| 图表 21: 今日拟建仓股票.....                        | 14 |
| 图表 22: 今日拟平仓股票.....                        | 15 |

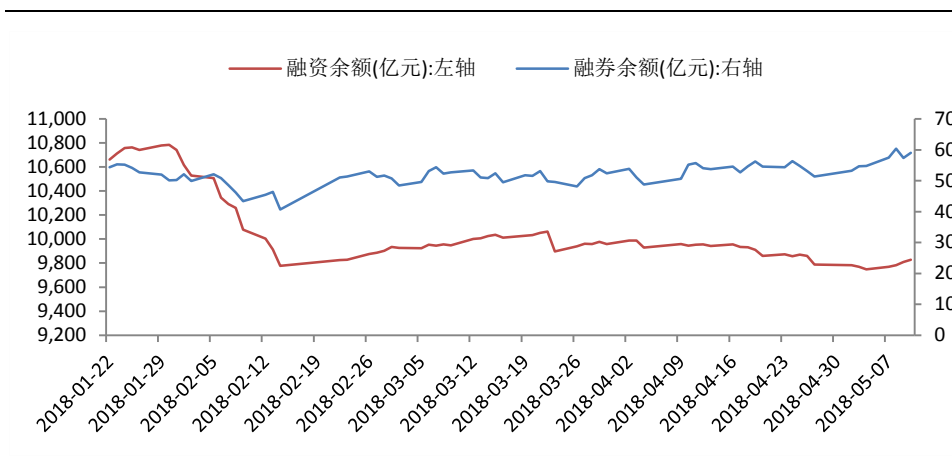
|                     |    |
|---------------------|----|
| 图表 23: 昨日建仓股票 ..... | 15 |
| 图表 24: 昨日平仓股票 ..... | 15 |
| 图表 25: 组合成分股 .....  | 15 |

## 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 9887.95 亿元(+0.23%)，其中融资余额规模为 9828.87 亿元(+0.21%)，融券余额规模为 59.08 亿元(+2.88%)。

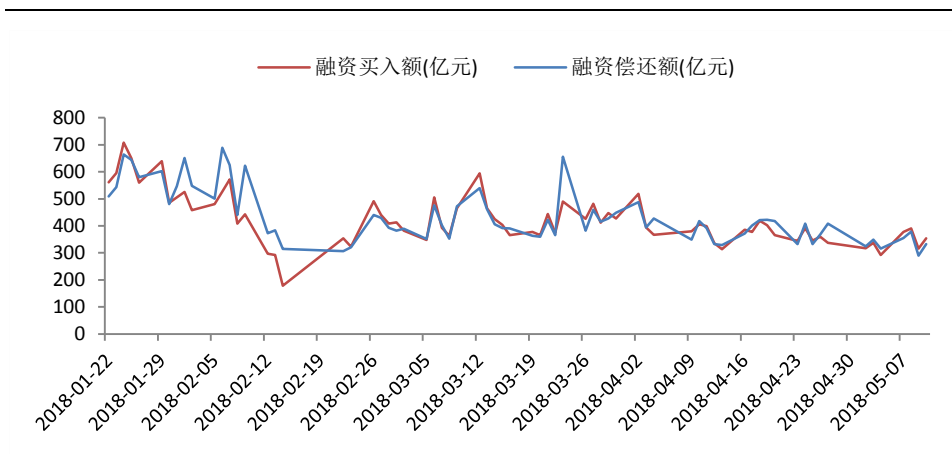
图表 1：近三月每日融资融券余额规模（亿元）



数据来源：Wind、信达证券研发中心

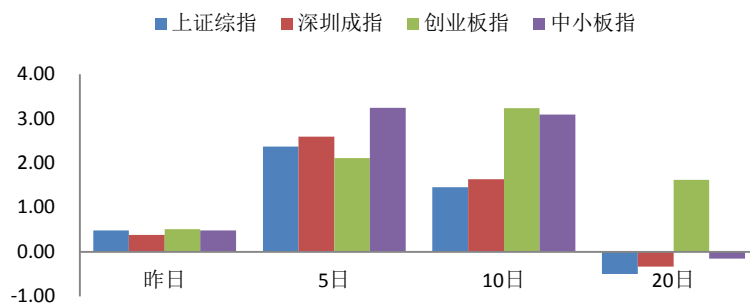
从融资规模来看，上一交易日沪深两市融资买入额为 353.13 亿元(+11.85%)，融资偿还额为 332.27 亿元(+14.69%)。

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，市场指数中创业板指表现较好，上涨 0.51%，深证成指表现最弱，上涨 0.38%；从 5 日涨跌幅看，中小板指表现较好，上涨 3.24%，创业板指表现最弱，上涨 2.11%；从 10 日涨跌幅看，创业板指表现较好，上涨 3.24%，上证综指表现最弱，上涨 1.45%；从 20 日涨跌幅看，创业板指表现较好，上涨 1.63%，上证综指表现最弱，下跌 0.5%。

**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，国防军工(+6.81%)、计算机(+2.28%)、通信(+1.35%)等行业增速居前，食品饮料(-1.78%)、休闲服务(-4.25%)、钢铁(-5.08%)等行业增速靠后。

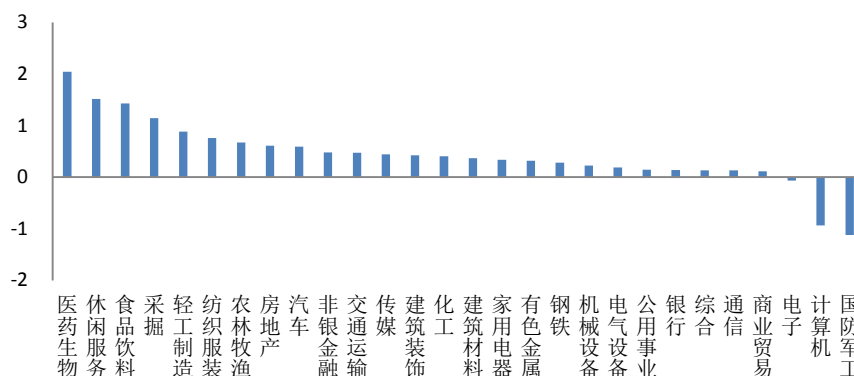
**图表 4：上一交易日两融标的股票分行业融资余额占流通市值比例及增速（%）**

| 序号 | 代码        | 行业   | 融资余额占流通市值比例(%) | 占比增速(%) |
|----|-----------|------|----------------|---------|
| 1  | 801740.SI | 国防军工 | 4.23           | 6.81    |
| 2  | 801750.SI | 计算机  | 7.29           | 2.28    |
| 3  | 801770.SI | 通信   | 5.94           | 1.35    |
| 4  | 801710.SI | 建筑材料 | 3.31           | 1.02    |
| 5  | 801180.SI | 房地产  | 3.47           | 0.83    |
| 6  | 801730.SI | 电气设备 | 3.85           | 0.65    |
| 7  | 801170.SI | 交通运输 | 1.88           | 0.35    |
| 8  | 801010.SI | 农林牧渔 | 3.31           | 0.09    |
| 9  | 801780.SI | 银行   | 1.05           | 0.02    |
| 10 | 801760.SI | 传媒   | 5.26           | -0.02   |
| 11 | 801230.SI | 综合   | 7.91           | -0.07   |
| 12 | 801080.SI | 电子   | 4.61           | -0.07   |
| 13 | 801160.SI | 公用事业 | 2.94           | -0.09   |
| 14 | 801200.SI | 商业贸易 | 4.67           | -0.16   |
| 15 | 801890.SI | 机械设备 | 3.59           | -0.26   |
| 16 | 801720.SI | 建筑装饰 | 2.45           | -0.33   |
| 17 | 801790.SI | 非银金融 | 2.66           | -0.37   |
| 18 | 801050.SI | 有色金属 | 5.98           | -0.45   |
| 19 | 801030.SI | 化工   | 2.74           | -0.55   |
| 20 | 801110.SI | 家用电器 | 1.97           | -0.68   |
| 21 | 801140.SI | 轻工制造 | 6.07           | -0.74   |
| 22 | 801020.SI | 采掘   | 0.92           | -0.85   |
| 23 | 801130.SI | 纺织服装 | 2.79           | -0.90   |
| 24 | 801150.SI | 医药生物 | 2.58           | -1.54   |
| 25 | 801880.SI | 汽车   | 2.36           | -1.75   |
| 26 | 801120.SI | 食品饮料 | 1.10           | -1.78   |
| 27 | 801210.SI | 休闲服务 | 2.04           | -4.25   |
| 28 | 801040.SI | 钢铁   | 2.81           | -5.08   |

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,医药生物(+2.04%)、休闲服务(+1.52%)、食品饮料(+1.43%)、采掘(+1.14%)、轻工制造(+0.88%)等行业表现较好,国防军工(-1.12%)、计算机(-0.94%)、电子(-0.06%)、商业贸易(+0.11%)、通信(+0.13%)等行业表现较弱。

图表 5: 申万行业上一交易日涨跌幅(%)

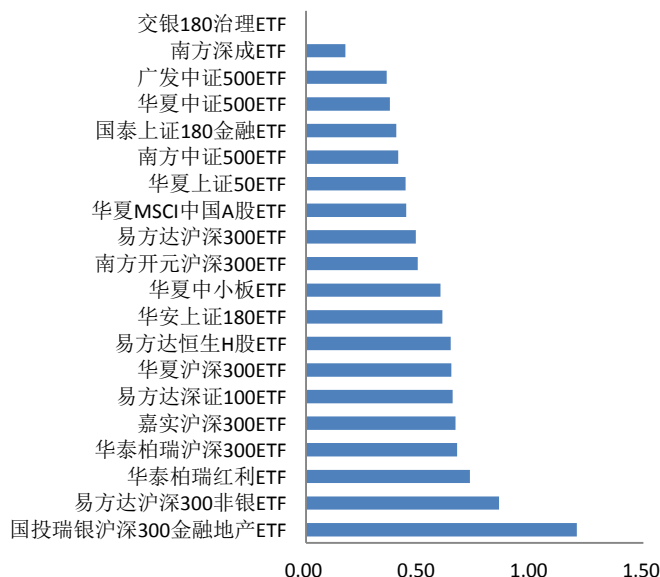


数据来源: Wind、信达证券研发中心

### 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(+1.2%)、易方达沪深 300 非银 ETF(+0.86%)及华泰柏瑞红利 ETF(+0.73%);跌幅前三名为:交银 180 治理 ETF(+0%)、南方深成 ETF(+0.17%)及广发中证 500ETF(+0.36%)。

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:世荣兆业(+9.98%)、天坛生物(+7.79%)、古井贡酒(+7.66%)、金牛化工(+6.87%)和恒瑞医药(+6.67%);跌幅前五名为:新安股份(-5.95%)、北方华创(-5.23%)、太极股份(-5.08%)、新潮能源(-4.92%)

和用友网络 (-3.67%)。

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  | 002016.SZ | 世荣兆业 | 9.98     | 1.45 | 600596.SH | 新安股份 | -5.95    | 2.13 |
| 2  | 600161.SH | 天坛生物 | 7.79     | 4.82 | 002371.SZ | 北方华创 | -5.23    | 1.06 |
| 3  | 000596.SZ | 古井贡酒 | 7.66     | 1.84 | 002368.SZ | 太极股份 | -5.08    | 1.27 |
| 4  | 600722.SH | 金牛化工 | 6.87     | 7.40 | 600777.SH | 新潮能源 | -4.92    | 0.00 |
| 5  | 600276.SH | 恒瑞医药 | 6.67     | 2.86 | 600588.SH | 用友网络 | -3.67    | 1.05 |
| 6  | 002007.SZ | 华兰生物 | 6.64     | 3.35 | 000977.SZ | 浪潮信息 | -3.63    | 0.79 |
| 7  | 002055.SZ | 得润电子 | 6.30     | 6.66 | 600677.SH | 航天通信 | -3.62    | 1.42 |
| 8  | 300015.SZ | 爱尔眼科 | 5.87     | 1.65 | 300226.SZ | 上海钢联 | -3.56    | 1.08 |
| 9  | 600325.SH | 华发股份 | 5.57     | 2.03 | 600716.SH | 凤凰股份 | -3.41    | 1.98 |
| 10 | 600804.SH | 鹏博士  | 5.52     | 4.38 | 600570.SH | 恒生电子 | -3.35    | 1.18 |
| 11 | 600337.SH | 美克家居 | 5.20     | 5.82 | 002577.SZ | 雷柏科技 | -3.17    | 0.59 |
| 12 | 002229.SZ | 鸿博股份 | 5.12     | 1.53 | 600257.SH | 大湖股份 | -3.13    | 0.69 |
| 13 | 002557.SZ | 洽洽食品 | 4.94     | 1.08 | 300058.SZ | 蓝色光标 | -3.10    | 1.87 |
| 14 | 002158.SZ | 汉钟精机 | 4.93     | 2.37 | 601199.SH | 江南水务 | -3.05    | 2.72 |
| 15 | 600594.SH | 益佰制药 | 4.75     | 1.78 | 000768.SZ | 中航飞机 | -2.98    | 1.42 |
| 16 | 002117.SZ | 东港股份 | 4.73     | 1.31 | 600614.SH | 鹏起科技 | -2.96    | 0.98 |
| 17 | 300122.SZ | 智飞生物 | 4.62     | 1.55 | 600855.SH | 航天长峰 | -2.91    | 1.30 |
| 18 | 600185.SH | 格力地产 | 4.60     | 2.84 | 002023.SZ | 海特高新 | -2.69    | 0.85 |
| 19 | 600684.SH | 珠江实业 | 4.46     | 3.84 | 601021.SH | 春秋航空 | -2.67    | 0.84 |
| 20 | 600827.SH | 百联股份 | 4.34     | 2.12 | 002405.SZ | 四维图新 | -2.53    | 1.03 |

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：金牛化工（7.4）、得润电子（6.66）、宋都股份（6.15）、美克家居（5.82）和天坛生物（4.82）。

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  | 600722.SH | 金牛化工 | 6.87     | 7.40 |
| 2  | 002055.SZ | 得润电子 | 6.30     | 6.66 |
| 3  | 600077.SH | 宋都股份 | 3.49     | 6.15 |
| 4  | 600337.SH | 美克家居 | 5.20     | 5.82 |
| 5  | 600161.SH | 天坛生物 | 7.79     | 4.82 |
| 6  | 600039.SH | 四川路桥 | 2.40     | 4.42 |
| 7  | 600804.SH | 鹏博士  | 5.52     | 4.38 |
| 8  | 000089.SZ | 深圳机场 | 1.15     | 4.24 |
| 9  | 600684.SH | 珠江实业 | 4.46     | 3.84 |
| 10 | 600229.SH | 城市传媒 | 3.00     | 3.61 |
| 11 | 002477.SZ | 雏鹰农牧 | 2.82     | 3.52 |
| 12 | 002007.SZ | 华兰生物 | 6.64     | 3.35 |
| 13 | 002071.SZ | 长城影视 | 0.11     | 3.25 |
| 14 | 000088.SZ | 盐田港  | 2.75     | 3.01 |

|    |           |      |      |      |
|----|-----------|------|------|------|
| 15 | 600162.SH | 香江控股 | 1.97 | 2.96 |
| 16 | 300001.SZ | 特锐德  | 4.16 | 2.93 |
| 17 | 600276.SH | 恒瑞医药 | 6.67 | 2.86 |
| 18 | 600185.SH | 格力地产 | 4.60 | 2.84 |
| 19 | 600239.SH | 云南城投 | 4.12 | 2.75 |
| 20 | 000554.SZ | 泰山石油 | 3.68 | 2.74 |

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: 新南洋(53.81%)、金发科技(52.47%)、华电国际(51.71%)、华侨城 A(51.23%)、国投资本(50.7%)。

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  | 600661.SH | 新南洋   | 1.08     | 53.81     | 13.52      |
| 2  | 600143.SH | 金发科技  | 2.06     | 52.47     | 24.27      |
| 3  | 600027.SH | 华电国际  | 3.57     | 51.71     | 64.10      |
| 4  | 000069.SZ | 华侨城 A | 2.48     | 51.23     | 154.33     |
| 5  | 600061.SH | 国投资本  | 3.61     | 50.70     | 57.01      |
| 6  | 000157.SZ | 中联重科  | 0.47     | 45.21     | 37.57      |
| 7  | 600686.SH | 金龙汽车  | 2.46     | 44.01     | 46.31      |
| 8  | 600572.SH | 康恩贝   | 2.89     | 43.19     | 120.47     |
| 9  | 601929.SH | 吉视传媒  | 0.73     | 41.87     | 9.56       |
| 10 | 000897.SZ | 津滨发展  | 1.01     | 41.14     | 6.33       |
| 11 | 600518.SH | 康美药业  | 2.46     | 40.83     | 195.00     |
| 12 | 601006.SH | 大秦铁路  | 1.62     | 39.42     | 117.00     |
| 13 | 600162.SH | 香江控股  | 1.97     | 39.34     | 31.62      |
| 14 | 601727.SH | 上海电气  | 1.03     | 38.95     | 26.67      |
| 15 | 601169.SH | 北京银行  | 0.88     | 38.46     | 74.20      |
| 16 | 601333.SH | 广深铁路  | 0.86     | 36.29     | 27.58      |
| 17 | 600170.SH | 上海建工  | 0.82     | 35.92     | 23.44      |
| 18 | 600548.SH | 深高速   | 1.27     | 34.71     | 6.35       |
| 19 | 002736.SZ | 国信证券  | 1.68     | 34.50     | 31.25      |
| 20 | 600336.SH | 澳柯玛   | 3.74     | 34.50     | 20.72      |

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: 上海建工(39.42%)、北京银行(34.95%)、新南洋(31.79%)、中国国贸(28.37%)、吉视传媒(26.91%); 尾盘金额流入率最高的前五名是: 广深铁路(31.11%)、金发科技(29.76%)、华邦健康(28.78%)、市北高新(20.63%)、皖江物流(18.97%)。

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  | 600170.SH | 上海建工 | 0.82     | 39.42     | 25.72      | 601333.SH | 广深铁路 | 0.86     | 31.11     | 23.68      |
| 2  | 601169.SH | 北京银行 | 0.88     | 34.95     | 67.58      | 600143.SH | 金发科技 | 2.06     | 29.76     | 14.20      |
| 3  | 600661.SH | 新南洋  | 1.08     | 31.79     | 8.01       | 002004.SZ | 华邦健康 | 1.48     | 28.78     | 15.10      |
| 4  | 600007.SH | 中国国贸 | 0.14     | 28.37     | 5.21       | 600604.SH | 市北高新 | 0.96     | 20.63     | 11.40      |
| 5  | 601929.SH | 吉视传媒 | 0.73     | 26.91     | 6.15       | 600575.SH | 皖江物流 | 0.27     | 18.97     | 3.56       |
| 6  | 600664.SH | 哈药股份 | 0.40     | 24.98     | 20.33      | 600068.SH | 葛洲坝  | 1.63     | 18.49     | 40.10      |

|    |           |      |      |       |        |           |       |      |       |       |
|----|-----------|------|------|-------|--------|-----------|-------|------|-------|-------|
| 7  | 601633.SH | 长城汽车 | 0.64 | 23.51 | 10.25  | 600369.SH | 西南证券  | 1.80 | 18.32 | 13.96 |
| 8  | 601901.SH | 方正证券 | 0.98 | 21.14 | 16.60  | 601000.SH | 唐山港   | 0.66 | 17.94 | 10.00 |
| 9  | 601607.SH | 上海医药 | 0.72 | 20.87 | 86.40  | 600333.SH | 长春燃气  | 1.64 | 17.93 | 5.31  |
| 10 | 600467.SH | 好当家  | 0.74 | 19.90 | 3.12   | 600169.SH | 太原重工  | 0.35 | 17.37 | 2.95  |
| 11 | 600077.SH | 宋都股份 | 3.49 | 19.38 | 17.86  | 600692.SH | 亚通股份  | 1.09 | 16.97 | 4.05  |
| 12 | 600548.SH | 深高速  | 1.27 | 19.20 | 3.52   | 000680.SZ | 山推股份  | 0.73 | 16.73 | 3.95  |
| 13 | 600748.SH | 上实发展 | 0.17 | 19.05 | 3.12   | 601099.SH | 太平洋   | 0.35 | 16.70 | 13.06 |
| 14 | 600169.SH | 太原重工 | 0.35 | 18.88 | 3.21   | 600380.SH | 健康元   | 1.61 | 16.51 | 27.24 |
| 15 | 600062.SH | 华润双鹤 | 1.73 | 17.97 | 33.41  | 601633.SH | 长城汽车  | 0.64 | 16.48 | 7.19  |
| 16 | 600350.SH | 山东高速 | 0.19 | 16.57 | 2.81   | 000966.SZ | 长源电力  | 0.61 | 16.24 | 1.63  |
| 17 | 601899.SH | 紫金矿业 | 0.74 | 16.50 | 61.72  | 600851.SH | 海欣股份  | 1.27 | 16.21 | 3.01  |
| 18 | 600188.SH | 兖州煤业 | 2.84 | 16.04 | 104.14 | 002203.SZ | 海亮股份  | 0.98 | 15.50 | 12.95 |
| 19 | 000731.SZ | 四川美丰 | 0.55 | 15.16 | 5.26   | 002022.SZ | 科华生物  | 1.93 | 15.31 | 19.10 |
| 20 | 601333.SH | 广深铁路 | 0.86 | 15.00 | 11.42  | 000565.SZ | 渝三峡 A | 0.64 | 15.04 | 1.97  |

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全柴动力(23.06%)、恒泰艾普(20.51%)、数码科技(19.31%)等,融资余额占流通市值比例增速前十名为江河集团(+7154.94%)、海越股份(+5612.96%)、达安基因(+4865.54%)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  | 600218.SH | 全柴动力 | 23.06           | 601886.SH | 江河集团 | 7154.94  |
| 2  | 300157.SZ | 恒泰艾普 | 20.51           | 600387.SH | 海越股份 | 5612.96  |
| 3  | 300079.SZ | 数码科技 | 19.31           | 002030.SZ | 达安基因 | 4865.54  |
| 4  | 000551.SZ | 创元科技 | 18.24           | 600288.SH | 大恒科技 | 3318.08  |
| 5  | 002067.SZ | 景兴纸业 | 18.13           | 601678.SH | 滨化股份 | 2975.68  |
| 6  | 600692.SH | 亚通股份 | 17.92           | 002308.SZ | 威创股份 | 2740.07  |
| 7  | 002148.SZ | 北纬科技 | 17.28           | 000851.SZ | 高鸿股份 | 2228.00  |
| 8  | 000917.SZ | 电广传媒 | 17.15           | 603323.SH | 吴江银行 | 2141.48  |
| 9  | 300090.SZ | 盛运环保 | 16.55           | 002369.SZ | 卓翼科技 | 2116.25  |
| 10 | 002104.SZ | 恒宝股份 | 16.45           | 600491.SH | 龙元建设 | 1963.55  |

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华银电力、辽宁成大、光明乳业等 19 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  | 600744.SH | 华银电力 | 2.94  | 3.25     | -9.54   | 3.28  | 214.00      | 629.16   |
| 2  | 600739.SH | 辽宁成大 | 17.11 | 17.12    | -0.06   | 17.11 | 349.45      | 5979.01  |
| 3  | 600597.SH | 光明乳业 | 11.42 | 11.33    | 0.79    | 11.42 | 32.16       | 367.21   |
| 4  | 600240.SH | 华业资本 | 7.91  | 7.91     | 0.00    | 7.91  | 1502.01     | 11880.89 |
| 5  | 600201.SH | 生物股份 | 23.50 | 24.80    | -5.24   | 24.71 | 23.00       | 540.50   |
| 6  | 600325.SH | 华发股份 | 8.72  | 8.26     | 5.57    | 8.72  | 24.57       | 214.25   |

|    |           |      |       |       |       |       |         |          |
|----|-----------|------|-------|-------|-------|-------|---------|----------|
| 7  | 601225.SH | 陕西煤业 | 7.41  | 8.23  | -9.96 | 8.45  | 1520.00 | 11263.20 |
| 8  | 600867.SH | 通化东宝 | 26.48 | 29.41 | -9.96 | 30.16 | 189.00  | 5004.72  |
| 9  | 002027.SZ | 分众传媒 | 10.50 | 11.40 | -7.89 | 11.37 | 1800.00 | 18900.00 |
| 10 | 000002.SZ | 万科A  | 27.37 | 28.20 | -2.94 | 28.07 | 1252.00 | 34267.24 |
| 11 | 000725.SZ | 京东方A | 4.86  | 4.56  | 6.58  | 4.49  | 57.70   | 280.42   |
| 12 | 000333.SZ | 美的集团 | 48.56 | 53.95 | -9.99 | 54.38 | 256.83  | 12471.66 |
| 13 | 600067.SH | 冠城大通 | 5.59  | 5.08  | 10.04 | 5.11  | 650.00  | 3633.50  |
| 14 | 002431.SZ | 棕榈股份 | 6.80  | 7.25  | -6.21 | 7.28  | 390.63  | 2656.25  |
| 15 | 600196.SH | 复星医药 | 43.35 | 42.74 | 1.43  | 43.35 | 5.00    | 216.75   |
| 16 | 600157.SH | 永泰能源 | 2.20  | 2.36  | -6.78 | 2.39  | 8170.00 | 17974.00 |
| 17 | 002308.SZ | 威创股份 | 9.29  | 9.25  | 0.43  | 9.29  | 52.72   | 489.80   |
| 18 | 002085.SZ | 万丰奥威 | 9.91  | 9.85  | 0.61  | 9.91  | 42.00   | 416.22   |
| 19 | 002117.SZ | 东港股份 | 15.90 | 16.29 | -2.39 | 17.06 | 250.00  | 3975.00  |

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 44 只标的股票停牌，其中今日开始停牌股票有长园集团等 1 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  | 600525.SH | 长园集团 | 停牌   | 2018-05-11 | 0    | 0.00       |           |
| 2  | 601390.SH | 中国中铁 | 停牌   | 2018-05-07 | 4    | 2.70       | 重要事项未公告   |
| 3  | 002011.SZ | 盾安环境 | 停牌   | 2018-05-02 | 9    | 2.99       | 拟披露重大事项   |
| 4  | 002183.SZ | 怡亚通  | 停牌   | 2018-05-02 | 9    | 2.99       | 拟披露重大事项   |
| 5  | 600293.SH | 三峡新材 | 停牌   | 2018-05-02 | 9    | 2.99       | 重要事项未公告   |
| 6  | 600750.SH | 江中药业 | 停牌   | 2018-05-02 | 9    | 2.99       | 重要事项未公告   |
| 7  | 603188.SH | 亚邦股份 | 停牌   | 2018-05-02 | 9    | 2.99       | 重要事项未公告   |
| 8  | 000063.SZ | 中兴通讯 | 停牌   | 2018-04-17 | 24   | 2.05       | 重大事项      |
| 9  | 000825.SZ | 太钢不锈 | 停牌   | 2018-04-16 | 25   | 0.49       | 重大资产重组    |
| 10 | 600490.SH | 鹏欣资源 | 停牌   | 2018-04-16 | 25   | 0.49       | 重大资产重组    |
| 11 | 002051.SZ | 中工国际 | 停牌   | 2018-04-09 | 32   | 1.38       | 重大资产重组    |
| 12 | 600335.SH | 国机汽车 | 停牌   | 2018-04-03 | 38   | 0.36       | 重大事项      |
| 13 | 002002.SZ | 鸿达兴业 | 停牌   | 2018-03-27 | 45   | 1.30       | 重大资产重组    |
| 14 | 600022.SH | 山东钢铁 | 停牌   | 2018-03-27 | 45   | 1.30       | 重大资产重组    |
| 15 | 600158.SH | 中体产业 | 停牌   | 2018-03-27 | 45   | 1.30       | 拟筹划重大资产重组 |
| 16 | 600759.SH | 洲际油气 | 停牌   | 2018-03-27 | 45   | 1.30       | 重大资产重组    |
| 17 | 002210.SZ | 飞马国际 | 停牌   | 2018-03-26 | 46   | 0.69       | 拟披露重大事项   |
| 18 | 600318.SH | 新力金融 | 停牌   | 2018-03-23 | 49   | -2.73      | 重要事项未公告   |
| 19 | 600880.SH | 博瑞传播 | 停牌   | 2018-03-06 | 66   | -2.53      | 重大事项      |
| 20 | 600987.SH | 航民股份 | 停牌   | 2018-03-05 | 67   | -2.46      | 拟筹划重大资产重组 |
| 21 | 000506.SZ | 中润资源 | 停牌   | 2018-02-28 | 72   | -3.57      | 重大资产重组    |
| 22 | 002252.SZ | 上海莱士 | 停牌   | 2018-02-23 | 77   | -2.88      | 重大资产重组    |

|    |           |       |    |            |     |        |           |
|----|-----------|-------|----|------------|-----|--------|-----------|
| 23 | 002437.SZ | 誉衡药业  | 停牌 | 2018-02-08 | 92  | -4.07  | 重大资产重组    |
| 24 | 002161.SZ | 远望谷   | 停牌 | 2018-02-05 | 95  | -8.31  | 重大资产重组    |
| 25 | 000793.SZ | 华闻传媒  | 停牌 | 2018-02-01 | 99  | -8.80  | 重大资产重组    |
| 26 | 600568.SH | 中珠医疗  | 停牌 | 2018-02-01 | 99  | -8.80  | 重大资产重组    |
| 27 | 300146.SZ | 汤臣倍健  | 停牌 | 2018-01-31 | 100 | -8.99  | 重大资产重组    |
| 28 | 000616.SZ | 海航投资  | 停牌 | 2018-01-24 | 107 | -10.49 | 重大资产重组    |
| 29 | 600515.SH | 海航基础  | 停牌 | 2018-01-23 | 108 | -9.34  | 重大资产重组    |
| 30 | 600086.SH | 东方金钰  | 停牌 | 2018-01-19 | 112 | -8.64  | 重大资产重组    |
| 31 | 000415.SZ | 渤海金控  | 停牌 | 2018-01-17 | 114 | -7.63  | 重大资产重组    |
| 32 | 600751.SH | 海航科技  | 停牌 | 2018-01-12 | 119 | -7.33  | 拟筹划重大资产重组 |
| 33 | 600221.SH | 海航控股  | 停牌 | 2018-01-10 | 121 | -7.02  | 重大资产重组    |
| 34 | 002005.SZ | 德豪润达  | 停牌 | 2018-01-02 | 129 | -4.01  | 重大资产重组    |
| 35 | 000156.SZ | 华数传媒  | 停牌 | 2017-12-26 | 136 | -3.23  | 重大资产重组    |
| 36 | 000812.SZ | 陕西金叶  | 停牌 | 2017-12-07 | 155 | -3.63  | 重大资产重组    |
| 37 | 600309.SH | 万华化学  | 停牌 | 2017-12-05 | 157 | -4.09  | 重大资产重组    |
| 38 | 300090.SZ | 盛运环保  | 停牌 | 2017-12-01 | 161 | -4.30  | 重大资产重组    |
| 39 | 000022.SZ | 深赤湾 A | 停牌 | 2017-11-20 | 172 | -6.16  | 重大资产重组    |
| 40 | 000939.SZ | 凯迪生态  | 停牌 | 2017-11-16 | 176 | -6.70  | 重大资产重组    |
| 41 | 000900.SZ | 现代投资  | 停牌 | 2017-10-27 | 196 | -6.84  | 重大资产重组    |
| 42 | 000930.SZ | 中粮生化  | 停牌 | 2017-10-24 | 199 | -6.10  | 重大资产重组    |
| 43 | 000540.SZ | 中天金融  | 停牌 | 2017-08-21 | 263 | -2.89  | 重大资产重组    |
| 44 | 600485.SH | 信威集团  | 停牌 | 2016-12-26 | 501 | 2.07   | 重大资产重组    |

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沃尔核材、齐峰新材、万达信息等 4 只, 大股东减持标的股票有万达信息等 1 只。

图表 14: 大股东持股比例变动标的股票

| 编号 | 股票代码      | 股票简称 | 公告日期      | 变动截止日期     | 变动方向 | 变动数量占流通股比例 (%) | 通过大宗交易变动比例 (%) | 变动后持股比例 (%) | 交易均价    | 变动期间股票均价 | 前涨跌幅 (%) |
|----|-----------|------|-----------|------------|------|----------------|----------------|-------------|---------|----------|----------|
| 1  | 002130.SZ | 沃尔核材 | 2018/5/11 | 2018/5/9   | 增持   | 2.5652         | 100            | 1.976       | 5.26    | 5.40565  |          |
| 2  | 002521.SZ | 齐峰新材 | 2018/5/11 | 2018/5/10  | 增持   | 0.28           | 0.00           | 1.30        |         | 7.68     | -0.39    |
| 3  | 300168.SZ | 万达信息 | 2018/5/11 | 2018/5/10  | 增持   | 1.4656         | 100.00         | 3.64        | 17.25   | 20.68    |          |
| 4  | 300168.SZ | 万达信息 | 2018/5/11 | 2018/4/27  | 增持   | 1.3725         | 0.00           | 1.36        | 18.38   | 18.09    |          |
| 5  | 300168.SZ | 万达信息 | 2018/5/11 | 2018/4/27  | 增持   | 2.20           | 0.00           | 2.19        | 18.01   | 18.09    | 1.71     |
| 6  | 300168.SZ | 万达信息 | 2018/5/11 | 2018/1/31  | 增持   | 0.01           | 0.00           | 0.86        | 13.51   | 13.72    | 1.71     |
| 7  | 600067.SH | 冠城大通 | 2018/5/11 | 2018/5/10  | 增持   | 0.53           | 0.00           | 32.63       |         | 5.92     | 0.59     |
| 8  | 300168.SZ | 万达信息 | 2018/5/11 | 2018/4/27  | 减持   | 0.25           | 0.00           | 0.60        | 14.50   | 18.09    | 1.71     |
| 9  | 300168.SZ | 万达信息 | 2018/5/11 | 2018/3/30  | 减持   | 0.0068         | 0              | 0.8511      | 16.125  | 16.9101  |          |
| 10 | 300168.SZ | 万达信息 | 2018/5/11 | 2018/2/28  | 减持   |                | 0.00           | 0.86        | 14.22   | 14.36    | 1.71     |
| 11 | 300168.SZ | 万达信息 | 2018/5/11 | 2017/12/29 | 减持   | 0.0963         | 0              | 0.8511      | 12.7891 | 13.0319  |          |
| 12 | 300168.SZ | 万达信息 | 2018/5/11 | 2017/11/30 | 减持   | 0.0451         | 0              | 0.9453      | 12.74   | 12.9803  |          |

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,其中光迅科技等1只发布董事会预案,华银电力等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  | 600744.SH | 华银电力 | 2018-05-11 | 股东大会通过 |      | 定向   | 3.28  | 0.92     |
| 2  | 002281.SZ | 光迅科技 | 2018-05-11 | 董事会预案  |      | 定向   | 25.42 | 0.08     |

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51只标的股票涉及分红送转事件,其中有东旭光电、云南白药、四川九洲等19只股东大会通过,中泰化学、启明星辰、中国巨石等8只为实施公告日,康力电梯、中天金融、华能国际等18只为股权登记日,佛山照明、顺发恒业、万年青等6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  | 002092.SZ | 中泰化学 | 2018/5/11 | 是    | 0.15      | 实施公告日  | 11.09    | 1.00     | 1.35    |           |
| 2  | 002439.SZ | 启明星辰 | 2018/5/11 | 是    | 0.05      | 实施公告日  | 24.30    | -1.38    | 0.21    |           |
| 3  | 600176.SH | 中国巨石 | 2018/5/11 | 是    | 0.25      | 实施公告日  | 15.03    | 0.40     | 1.66    | 0.20      |
| 4  | 600987.SH | 航民股份 | 2018/5/11 | 是    | 0.28      | 实施公告日  | 11.57    | 0.00     | 2.42    |           |
| 5  | 601000.SH | 唐山港  | 2018/5/11 | 是    | 0.08      | 实施公告日  | 4.57     | 0.66     | 1.75    | 0.30      |
| 6  | 601128.SH | 常熟银行 | 2018/5/11 | 是    | 0.18      | 实施公告日  | 6.89     | -0.29    | 2.61    |           |
| 7  | 601168.SH | 西部矿业 | 2018/5/11 | 是    | 0.10      | 实施公告日  | 7.25     | -0.41    | 1.38    |           |
| 8  | 601996.SH | 丰林集团 | 2018/5/11 | 是    | 0.06      | 实施公告日  | 4.13     | 0.00     | 1.45    |           |
| 9  | 002367.SZ | 康力电梯 | 2018/5/17 | 是    | 0.15      | 股权登记日  | 8.30     | -0.24    | 1.81    |           |
| 10 | 000540.SZ | 中天金融 | 2018/5/16 | 是    | 0.05      | 股权登记日  | 7.35     | 0.00     | 0.68    | 0.50      |
| 11 | 600011.SH | 华能国际 | 2018/5/16 | 是    | 0.10      | 股权登记日  | 6.41     | 0.79     | 1.56    |           |
| 12 | 600064.SH | 南京高科 | 2018/5/16 | 是    | 0.10      | 股权登记日  | 14.41    | 2.20     | 0.69    | 0.60      |
| 13 | 000060.SZ | 中金岭南 | 2018/5/15 | 是    | 0.25      | 股权登记日  | 9.64     | 0.52     | 2.59    | 0.50      |
| 14 | 000600.SZ | 建投能源 | 2018/5/15 | 是    | 0.08      | 股权登记日  | 6.51     | 0.31     | 1.23    |           |
| 15 | 600059.SH | 古越龙山 | 2018/5/15 | 是    | 0.10      | 股权登记日  | 8.59     | -0.23    | 1.16    |           |
| 16 | 600523.SH | 贵航股份 | 2018/5/15 | 是    | 0.21      | 股权登记日  | 15.70    | 1.95     | 1.32    | 0.40      |
| 17 | 002148.SZ | 北纬科技 | 2018/5/14 | 是    | 0.08      | 股权登记日  | 7.52     | -0.53    | 1.06    |           |
| 18 | 002508.SZ | 老板电器 | 2018/5/14 | 是    | 0.75      | 股权登记日  | 38.59    | 2.06     | 1.94    |           |
| 19 | 002561.SZ | 徐家汇  | 2018/5/14 | 是    | 0.36      | 股权登记日  | 10.97    | 0.64     | 3.28    |           |
| 20 | 300202.SZ | 聚龙股份 | 2018/5/14 | 是    | 0.10      | 股权登记日  | 20.72    | 1.97     | 0.48    |           |
| 21 | 600582.SH | 天地科技 | 2018/5/14 | 是    | 0.05      | 股权登记日  | 4.35     | 0.23     | 1.15    |           |
| 22 | 601233.SH | 桐昆股份 | 2018/5/14 | 是    | 0.14      | 股权登记日  | 25.15    | 1.53     | 0.56    | 0.40      |
| 23 | 002230.SZ | 科大讯飞 | 2018/5/11 | 是    | 0.10      | 股权登记日  | 55.81    | 0.20     | 0.18    | 0.50      |
| 24 | 002285.SZ | 世联行  | 2018/5/11 | 是    | 0.08      | 股权登记日  | 8.30     | -0.60    | 0.96    |           |
| 25 | 002461.SZ | 珠江啤酒 | 2018/5/11 | 是    | 0.10      | 股权登记日  | 11.95    | 3.37     | 0.84    | 1.00      |
| 26 | 002474.SZ | 榕基软件 | 2018/5/11 | 是    | 0.01      | 股权登记日  | 9.45     | -1.56    | 0.11    |           |
| 27 | 000413.SZ | 东旭光电 | 2018/5/11 | 是    |           | 股东大会通过 | 7.90     | -1.13    |         |           |

|    |           |      |           |   |      |        |        |       |      |      |
|----|-----------|------|-----------|---|------|--------|--------|-------|------|------|
| 28 | 000538.SZ | 云南白药 | 2018/5/11 | 是 |      | 股东大会通过 | 108.08 | 0.72  |      |      |
| 29 | 000801.SZ | 四川九洲 | 2018/5/11 | 是 |      | 股东大会通过 | 6.22   | -1.27 |      |      |
| 30 | 000988.SZ | 华工科技 | 2018/5/11 | 是 |      | 股东大会通过 | 16.28  | 4.23  |      |      |
| 31 | 002110.SZ | 三钢闽光 | 2018/5/11 | 是 |      | 股东大会通过 | 18.34  | 0.38  |      |      |
| 32 | 002183.SZ | 怡亚通  | 2018/5/11 | 是 |      | 股东大会通过 | 7.17   | 0.00  |      |      |
| 33 | 002267.SZ | 陕天然气 | 2018/5/11 | 是 |      | 股东大会通过 | 7.68   | 0.00  |      |      |
| 34 | 002275.SZ | 桂林三金 | 2018/5/11 | 是 |      | 股东大会通过 | 16.14  | 0.94  |      |      |
| 35 | 002579.SZ | 中京电子 | 2018/5/11 | 是 |      | 股东大会通过 | 9.49   | 0.11  |      |      |
| 36 | 002595.SZ | 豪迈科技 | 2018/5/11 | 是 |      | 股东大会通过 | 15.16  | -2.32 |      |      |
| 37 | 600037.SH | 歌华有线 | 2018/5/11 | 是 |      | 股东大会通过 | 12.38  | 0.73  |      |      |
| 38 | 600111.SH | 北方稀土 | 2018/5/11 | 是 |      | 股东大会通过 | 12.80  | -0.39 |      |      |
| 39 | 600261.SH | 阳光照明 | 2018/5/11 | 是 |      | 股东大会通过 | 3.99   | 1.79  |      |      |
| 40 | 600376.SH | 首开股份 | 2018/5/11 | 是 |      | 股东大会通过 | 8.97   | -0.11 |      |      |
| 41 | 600410.SH | 华胜天成 | 2018/5/11 | 是 |      | 股东大会通过 | 11.57  | -1.95 |      |      |
| 42 | 600584.SH | 长电科技 | 2018/5/11 | 是 |      | 股东大会通过 | 19.99  | -1.19 |      |      |
| 43 | 600718.SH | 东软集团 | 2018/5/11 | 是 |      | 股东大会通过 | 14.71  | -1.80 |      |      |
| 44 | 600795.SH | 国电电力 | 2018/5/11 | 是 |      | 股东大会通过 | 2.89   | -0.34 |      |      |
| 45 | 600831.SH | 广电网络 | 2018/5/11 | 是 |      | 股东大会通过 | 8.19   | 1.61  |      |      |
| 46 | 000541.SZ | 佛山照明 | 2018/5/11 | 是 | 0.33 | 除权除息日  | 8.36   | 0.48  | 3.94 | 0.10 |
| 47 | 000631.SZ | 顺发恒业 | 2018/5/11 | 是 | 0.31 | 除权除息日  | 4.30   | 1.42  | 7.21 |      |
| 48 | 000789.SZ | 万年青  | 2018/5/11 | 是 | 0.35 | 除权除息日  | 13.49  | 0.90  | 2.59 |      |
| 49 | 002236.SZ | 大华股份 | 2018/5/11 | 是 | 0.20 | 除权除息日  | 24.12  | 0.42  | 0.83 |      |
| 50 | 002353.SZ | 杰瑞股份 | 2018/5/11 | 是 | 0.12 | 除权除息日  | 17.39  | 2.05  | 0.69 |      |
| 51 | 600007.SH | 中国国贸 | 2018/5/11 | 是 | 0.32 | 除权除息日  | 14.51  | 0.14  | 2.21 |      |

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 个交易日共有海大集团、金龙汽车、华数传媒等 11 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  | 002311.SZ | 海大集团 | 2018/5/11 | 1266.60  | 0.83         | 股权激励限售股份   | 25.55 | 0.51    |
| 2  | 600686.SH | 金龙汽车 | 2018/5/11 | 16414.14 | 37.09        | 定向增发机构配售股份 | 14.16 | 2.46    |
| 3  | 000156.SZ | 华数传媒 | 2018/5/14 | 28667.10 | 28.85        | 定向增发机构配售股份 | 11.40 | 0.00    |
| 4  | 601229.SH | 上海银行 | 2018/5/14 | 39.63    | 0.01         | 首发原股东限售股份  | 15.52 | 0.39    |
| 5  | 600998.SH | 九州通  | 2018/5/15 | 4862.67  | 2.95         | 股权激励限售股份   | 18.54 | -0.86   |
| 6  | 002074.SZ | 国轩高科 | 2018/5/16 | 23909.51 | 37.89        | 定向增发机构配售股份 | 18.02 | 0.17    |

|    |           |      |           |          |       |            |       |       |
|----|-----------|------|-----------|----------|-------|------------|-------|-------|
| 7  | 002299.SZ | 圣农发展 | 2018/5/18 | 20000.00 | 21.96 | 定向增发机构配售股份 | 15.71 | -0.06 |
| 8  | 600135.SH | 乐凯胶片 | 2018/5/21 | 464.88   | 1.26  | 定向增发机构配售股份 | 9.37  | -1.06 |
| 9  | 000001.SZ | 平安银行 | 2018/5/21 | 25224.80 | 1.49  | 定向增发机构配售股份 | 11.01 | 0.36  |
| 10 | 600958.SH | 东方证券 | 2018/5/21 | 2000.00  | 0.39  | 首发原股东限售股份  | 12.12 | 0.58  |
| 11 | 600637.SH | 东方明珠 | 2018/5/21 | 30835.65 | 19.25 | 定向增发机构配售股份 | 17.67 | 2.61  |

数据来源: Wind、信达证券研发中心

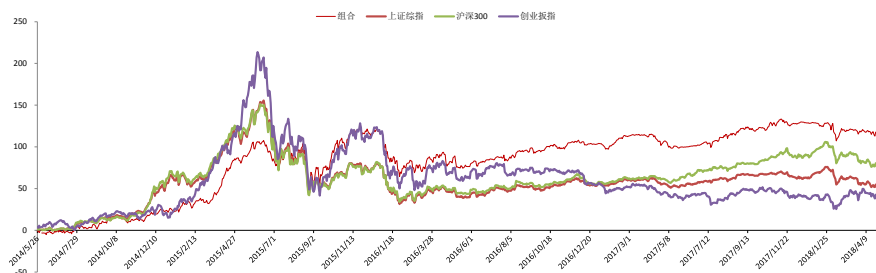
### 三、事件投资组合操作

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 0.31%, 至 2018 年 5 月 10 日组合累计收益率为 124.32%, 分别超越上证综指、沪深 300 及创业板指 67.27、41.62 及 77.38 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     | 2.72 | 3.09  | -1.04 | -2.55 | 11.78 | 10.38 |
| 上证综指   | 3.03 | 1.20  | -9.89 | -7.01 | 3.11  | 2.28  |
| 沪深 300 | 3.44 | 0.79  | -9.51 | -3.98 | 15.91 | 17.61 |
| 创业板指   | 3.54 | -0.38 | 3.64  | 0.34  | 4.29  | -4.93 |

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: 徐家汇(分红送转)。

图表 21: 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  | 002561.SZ | 徐家汇  | 3.00  | 0.64    | 分红送转 |

数据来源: Wind、信达证券研发中心

##### 2) 今日拟平仓股票

今日拟平仓股票有桐昆股份、三峡新材等 2 只。

**图表 22：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  | 601233.SH | 桐昆股份 | 2018/4/2 | 3.00  | 11.00     |
| 2  | 600293.SH | 三峡新材 | 2018/4/3 | 3.00  | -17.06    |

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 23：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

昨日平仓股票有苏宁易购、海大集团等 2 只。

**图表 24：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  | 002024.SZ | 苏宁易购 | 2018/04/02 | 14.37 | 3.00  | 13.70 | -4.64     |
| 2  | 002311.SZ | 海大集团 | 2018/04/02 | 25.04 | 3.00  | 25.43 | 1.55      |

数据来源：Wind、信达证券研发中心

### 4. 组合成分股

至 2018 年 5 月 10 日收盘，组合共有成分股 21 只，仓位 63.01%。

**图表 25：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  | 601233.SH | 桐昆股份 | 2018/4/2  | 22.66 | 3.00  | 25.15 | 11.00    | 10.83     |
| 2  | 600293.SH | 三峡新材 | 2018/4/3  | 6.97  | 3.00  | 5.78  | -17.06   | -17.42    |
| 3  | 000581.SZ | 威孚高科 | 2018/4/4  | 23.00 | 3.00  | 23.38 | 1.65     | 0.45      |
| 4  | 000738.SZ | 航发控制 | 2018/4/11 | 16.42 | 3.00  | 15.17 | -7.64    | -7.14     |
| 5  | 600596.SH | 新安股份 | 2018/4/11 | 14.60 | 3.00  | 16.75 | 14.72    | 15.22     |
| 6  | 000078.SZ | 海王生物 | 2018/4/12 | 5.98  | 3.00  | 5.93  | -0.76    | 0.29      |
| 7  | 000830.SZ | 鲁西化工 | 2018/4/12 | 17.92 | 3.00  | 19.60 | 9.35     | 10.40     |
| 8  | 000975.SZ | 银泰资源 | 2018/4/13 | 16.40 | 3.00  | 16.24 | -1.00    | -0.82     |
| 9  | 001979.SZ | 招商蛇口 | 2018/4/13 | 22.16 | 3.00  | 23.17 | 4.57     | 4.76      |
| 10 | 000631.SZ | 顺发恒业 | 2018/4/16 | 4.01  | 3.00  | 4.30  | 7.25     | 6.76      |
| 11 | 000883.SZ | 湖北能源 | 2018/4/16 | 4.32  | 3.00  | 4.41  | 2.10     | 1.62      |
| 12 | 002016.SZ | 世荣兆业 | 2018/4/16 | 13.48 | 3.00  | 16.64 | 23.45    | 22.97     |
| 13 | 002579.SZ | 中京电子 | 2018/4/20 | 8.85  | 3.00  | 9.49  | 7.19     | 5.36      |
| 14 | 002118.SZ | 紫鑫药业 | 2018/4/20 | 9.28  | 3.00  | 9.72  | 4.79     | 2.96      |
| 15 | 601628.SH | 中国人寿 | 2018/4/23 | 24.39 | 3.00  | 25.42 | 4.24     | 0.89      |
| 16 | 002023.SZ | 海特高新 | 2018/4/25 | 11.81 | 3.00  | 11.96 | 1.23     | -0.22     |
| 17 | 002428.SZ | 云南锗业 | 2018/4/25 | 11.55 | 3.00  | 11.28 | -2.32    | -3.77     |
| 18 | 002078.SZ | 太阳纸业 | 2018/4/26 | 10.85 | 3.00  | 11.50 | 6.02     | 4.21      |
| 19 | 002396.SZ | 星网锐捷 | 2018/4/26 | 21.86 | 3.00  | 22.65 | 3.62     | 1.81      |

|    |           |      |           |       |      |       |      |      |
|----|-----------|------|-----------|-------|------|-------|------|------|
| 20 | 000975.SZ | 银泰资源 | 2018/4/27 | 15.28 | 3.00 | 16.24 | 6.25 | 3.02 |
| 21 | 600801.SH | 华新水泥 | 2018/4/27 | 14.23 | 3.00 | 14.90 | 4.68 | 1.45 |

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 | 巩婷婷 | 010-63081128 | 13811821399 | gongtingting@cindasc.com |
| 华东 | 王莉本 | 021-63570071 | 18121125183 | wangliben@cindasc.com    |
| 华东 | 文襄琳 | 021-61678569 | 13681810356 | wenxianglin@cindasc.com  |
| 华东 | 洪 辰 | 021-61678568 | 13818525553 | hongchen@cindasc.com     |
| 华南 | 袁 泉 | 010-63081270 | 13671072405 | yuanq@cindasc.com        |
| 国际 | 唐 蕾 | 010-63080945 | 18610350427 | tanglei@cindasc.com      |