

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6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 9769.08 亿元(-0.15%), 其中融资余额规模为 9706.2 亿元(-0.17%), 融券余额规模为 62.88 亿元(+2.65%)。从融资规模来看, 上一交易日沪深两市融资买入额为 225.71 亿元(-11.78%), 融资偿还额为 241.93 亿元(-16.06%)。
- 两融标的股票中, 涨幅前五名为: 电广传媒(+9.97%)、粤传媒(+9.94%)、鸿博股份(+7.45%)、探路者(+7.2%)和东阳光科(+5.94%); 跌幅前五名为: 翰宇药业(-10.01%)、威创股份(-9.97%)、晋亿实业(-9.88%)、陕天然气(-8.75%)和重庆啤酒(-7.75%)。
- 上一交易日, 发生大宗交易的标的股票有永泰能源、北方稀土、重庆啤酒等 16 只。
- 今日共有 48 只标的股票停牌, 其中今日没有开始停牌股票, 今日无复牌股票。
- 今日披露, 大股东增持标的股票有中粮地产、冀东水泥、雏鹰农牧等 5 只, 大股东减持标的股票有誉衡药业等 3 只。
- 今日披露, 共有 1 只标的股票涉及增发事件, 其中上海电力等 1 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 88 只标的股票涉及分红送转事件, 其中有粤电力 A、中国铁建等 2 只股东大会通过, 华润三九、华天科技、日海通讯等 10 只为实施公告日, 中航飞机、金正大、华夏幸福等 69 只为股权登记日, 苏宁环球、七匹狼、力生制药等 7 只为除权除息日。
- 今日共有多氟多等 1 只标的股票发布业绩预告。
- 未来 7 个交易日共有东方明珠、欧比特、中国核电等 10 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: 无。
- 今日无拟平仓股票。
- 上一交易日组合收益率为-0.07%, 至 2018 年 6 月 11 日组合累计收益率为 124.03%, 分别超越上证综指、沪深 300 及创业板指 73、46.64 及 91.02 个百分点。

目录

一、上一交易日市场回顾.....	3
1. 融资融券规模及主要市场指数表现.....	3
2. 标的 ETF 基金表现.....	4
3. 标的股票大宗交易.....	4
二、今日标的股票事件提示.....	5
1. 标的股票停复牌.....	5
2. 大股东增减持标的股票.....	6
3. 标的股票增发.....	6
4. 标的股票分红送转.....	7
5. 发布相关业绩报告的标的股票.....	9
6. 标的股票限售股解禁.....	9
三、事件投资组合操作.....	9
1. 组合历史收益.....	9
2. 今日组合操作.....	10
3. 昨日组合操作回顾.....	10
4. 组合成分股.....	11

图表目录

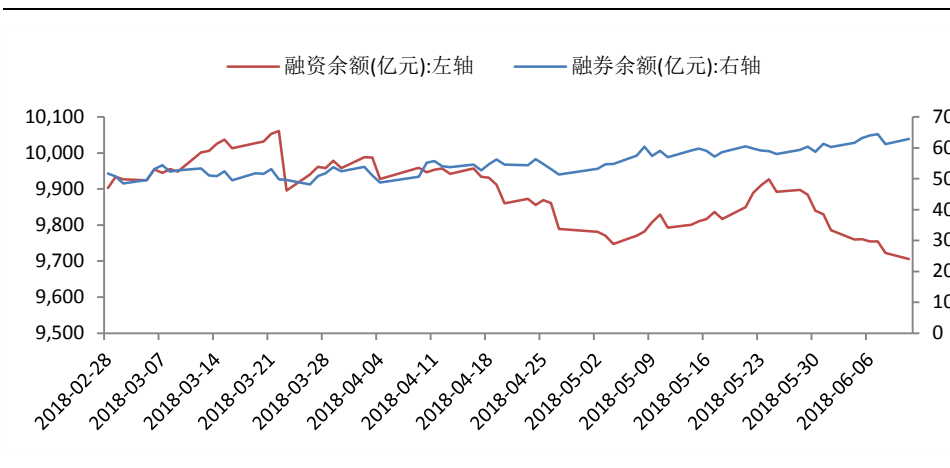
图表 1: 近三月每日融资融券余额规模（亿元）.....	3
图表 2: 近三月每日融资买入额及偿还额（亿元）.....	3
图表 3: 近期主要市场指数涨跌幅（%）.....	4
图表 4: 融资融券 ETF 上一交易日涨跌幅（%）.....	4
图表 5: 上一交易日发生大宗交易标的股票.....	4
图表 6: 复牌及停牌标的股票.....	5
图表 7: 大股东持股比例变动标的股票.....	6
图表 8: 未来七个交易日标的股票增发.....	7
图表 9: 未来七个交易日发生分红送转事件标的股票.....	7
图表 10: 今日发布相关业绩报告的标的股票.....	9
图表 11: 未来七个交易日标的股票限售解禁.....	9
图表 12: 组合历史收益曲线.....	10
图表 13: 组合历史收益对比.....	10
图表 14: 今日拟建仓股票.....	10
图表 15: 今日拟平仓股票.....	10
图表 16: 昨日建仓股票.....	10
图表 17: 昨日平仓股票.....	11
图表 18: 组合成分股.....	11

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 9769.08 亿元(-0.15%)，其中融资余额规模为 9706.2 亿元(-0.17%)，融券余额规模为 62.88 亿元(+2.65%)。

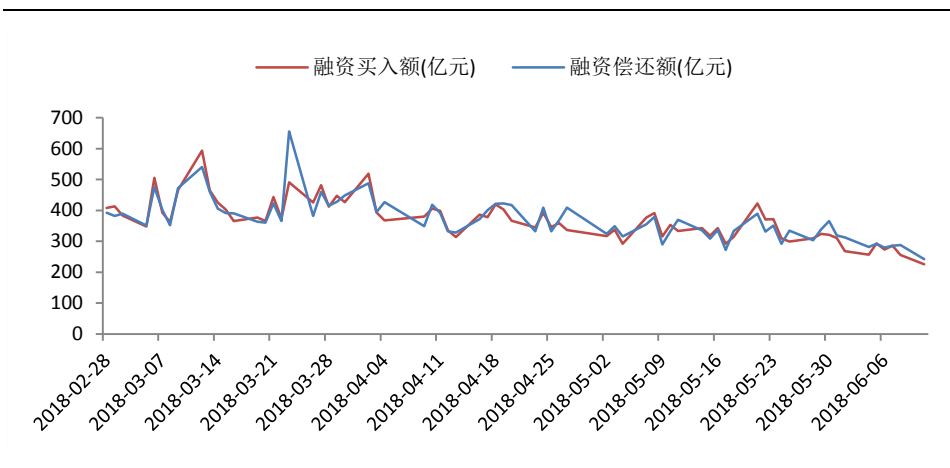
图表 1：近三月每日融资融券余额规模（亿元）



数据来源：Wind、信达证券研发中心

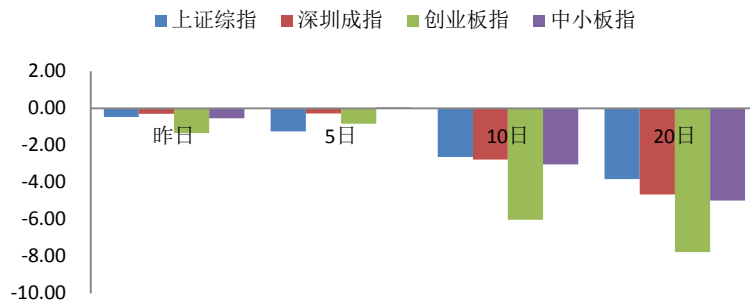
从融资规模来看，上一交易日沪深两市融资买入额为 225.71 亿元(-11.78%)，融资偿还额为 241.93 亿元(-16.06%)。

图表 2：近三月每日融资买入额及偿还额（亿元）



数据来源：Wind、信达证券研发中心

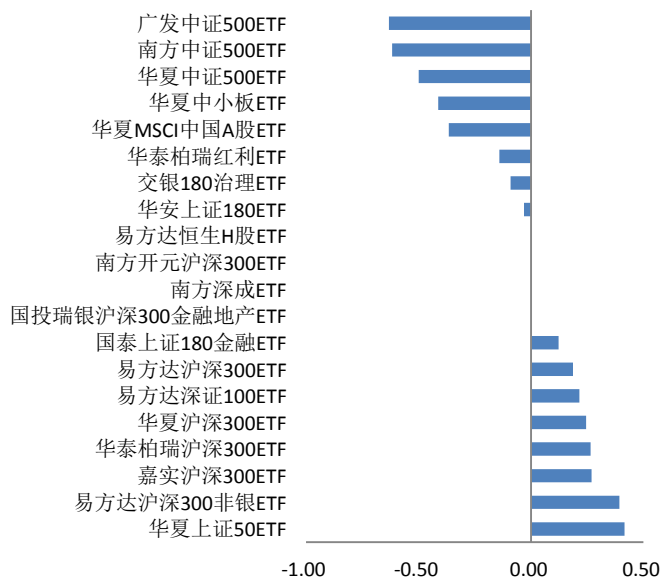
上一交易日，市场指数中深证成指表现较好，下跌 0.3%，创业板指表现最弱，下跌 1.34%；从 5 日涨跌幅看，中小板指表现较好，上涨 0.06%，上证综指表现最弱，下跌 1.24%；从 10 日涨跌幅看，上证综指表现较好，下跌 2.63%，创业板指表现最弱，下跌 6.03%；从 20 日涨跌幅看，上证综指表现较好，下跌 3.82%，创业板指表现最弱，下跌 7.78%。

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. 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：华夏上证 50ETF（+0.41%）、易方达沪深 300 非银 ETF（+0.39%）及嘉实沪深 300ETF（+0.27%）；跌幅前三名为：广发中证 500ETF（-0.63%）、南方中证 500ETF（-0.62%）及华夏中证 500ETF（-0.5%）。

图表 4：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

3. 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永泰能源、北方稀土、重庆啤酒等 16 只。

图表 5：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	600157.SH	永泰能源	1.82	1.84	-1.09	1.82	1700.00	3094.00
2	600111.SH	北方稀土	11.75	11.71	0.34	11.75	19.00	223.25
3	600132.SH	重庆啤酒	31.60	31.60	0.00	29.15	66.72	2108.48
4	600518.SH	康美药业	22.20	24.66	-9.98	24.22	2500.30	55506.68
5	600614.SH	鹏起科技	6.29	6.99	-10.01	7.06	319.24	2008.02
6	600668.SH	尖峰集团	13.34	14.38	-7.23	14.34	500.00	6670.00

7	600109.SH	国金证券	7.80	7.79	0.13	7.80	2960.77	23094.01
8	000776.SZ	广发证券	14.12	14.12	0.00	14.12	708.00	9996.96
9	000851.SZ	高鸿股份	4.98	5.53	-9.95	5.70	877.00	4367.46
10	000732.SZ	泰禾集团	21.39	21.90	-2.33	22.52	350.00	7486.50
11	000333.SZ	美的集团	49.19	54.66	-10.01	56.32	74.71	3674.99
12	000932.SZ	华菱钢铁	8.62	8.51	1.29	8.89	945.39	8149.26
13	600010.SH	宝钢股份	1.54	1.69	-8.88	1.70	140.00	215.60
14	600104.SH	上汽集团	36.39	36.04	0.97	36.39	29.21	1062.95
15	300498.SZ	温氏股份	21.05	23.39	-10.00	22.86	27.90	587.29
16	000960.SZ	锡业股份	13.03	14.32	-9.01	14.21	230.40	3002.13

数据来源: Wind、信达证券研发中心

二、今日标的股票事件提示

1. 标的股票停复牌

今日共有 48 只标的股票停牌, 其中今日没有开始停牌股票, 今日无复牌股票。

图表 6: 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	002437.SZ	誉衡药业	停牌	2018-06-11	1	-0.47	重大资产重组
2	002344.SZ	海宁皮城	停牌	2018-06-07	5	-2.00	重大事项
3	601727.SH	上海电气	停牌	2018-06-06	6	-1.97	拟筹划重大资产重组
4	600765.SH	中航重机	停牌	2018-06-05	7	-1.24	重要事项未公告
5	002450.SZ	康得新	停牌	2018-06-04	8	-0.73	重大事项
6	300090.SZ	盛运环保	停牌	2018-06-04	8	-0.73	拟披露重大事项
7	300253.SZ	卫宁健康	停牌	2018-06-04	8	-0.73	拟披露重大事项
8	300128.SZ	锦富技术	停牌	2018-06-01	11	-1.38	拟披露重大事项
9	002431.SZ	棕榈股份	停牌	2018-05-30	13	-2.17	重大事项
10	600175.SH	美都能源	停牌	2018-05-30	13	-2.17	拟筹划重大资产重组
11	600811.SH	东方集团	停牌	2018-05-30	13	-2.17	重要事项未公告
12	002310.SZ	东方园林	停牌	2018-05-25	18	-3.23	重大资产重组
13	601118.SH	海南橡胶	停牌	2018-05-24	19	-3.67	
14	600800.SH	天津磁卡	停牌	2018-05-21	22	-4.40	拟筹划重大资产重组
15	002369.SZ	卓翼科技	停牌	2018-05-14	29	-3.49	拟披露重大事项
16	601390.SH	中国中铁	停牌	2018-05-07	36	-1.24	重大资产重组
17	002011.SZ	盾安环境	停牌	2018-05-02	41	-0.96	重大资产重组
18	600293.SH	三峡新材	停牌	2018-05-02	41	-0.96	重要事项未公告
19	600750.SH	江中药业	停牌	2018-05-02	41	-0.96	重大资产重组
20	000063.SZ	中兴通讯	停牌	2018-04-17	56	-1.86	重大事项
21	000825.SZ	太钢不锈	停牌	2018-04-16	57	-3.36	重大资产重组
22	600490.SH	鹏欣资源	停牌	2018-04-16	57	-3.36	重大资产重组
23	002051.SZ	中工国际	停牌	2018-04-09	64	-2.50	重大资产重组
24	600335.SH	国机汽车	停牌	2018-04-03	70	-3.49	重大事项
25	002002.SZ	鸿达兴业	停牌	2018-03-27	77	-2.58	重大资产重组
26	600022.SH	山东钢铁	停牌	2018-03-27	77	-2.58	重大资产重组

27	600158.SH	中体产业	停牌	2018-03-27	77	-2.58	拟筹划重大资产重组
28	600759.SH	洲际油气	停牌	2018-03-27	77	-2.58	重大资产重组
29	002210.SZ	飞马国际	停牌	2018-03-26	78	-3.17	拟披露重大事项
30	600318.SH	新力金融	停牌	2018-03-23	81	-6.46	重大资产重组
31	600880.SH	博瑞传播	停牌	2018-03-06	98	-6.27	重大事项
32	000506.SZ	中润资源	停牌	2018-02-28	104	-7.27	重大资产重组
33	002252.SZ	上海莱士	停牌	2018-02-23	109	-6.60	重大资产重组
34	000793.SZ	华闻传媒	停牌	2018-02-01	131	-12.30	重大资产重组
35	600568.SH	中珠医疗	停牌	2018-02-01	131	-12.30	重大资产重组
36	300146.SZ	汤臣倍健	停牌	2018-01-31	132	-12.48	重大资产重组
37	000616.SZ	海航投资	停牌	2018-01-24	139	-13.92	重大资产重组
38	600515.SH	海航基础	停牌	2018-01-23	140	-12.81	重大资产重组
39	600086.SH	东方金钰	停牌	2018-01-19	144	-12.14	重大资产重组
40	000415.SZ	渤海金控	停牌	2018-01-17	146	-11.17	重大资产重组
41	600751.SH	海航科技	停牌	2018-01-12	151	-10.88	拟筹划重大资产重组
42	600221.SH	海航控股	停牌	2018-01-10	153	-10.58	重大资产重组
43	002005.SZ	德豪润达	停牌	2018-01-02	161	-7.69	重大资产重组
44	000156.SZ	华数传媒	停牌	2017-12-26	168	-6.94	重大资产重组
45	000022.SZ	深赤湾 A	停牌	2017-11-20	204	-9.76	重大资产重组
46	000939.SZ	凯迪生态	停牌	2017-11-16	208	-10.28	重大资产重组
47	000540.SZ	中天金融	停牌	2017-08-21	295	-6.61	重大资产重组
48	600485.SH	信威集团	停牌	2016-12-26	533	-1.84	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中粮地产、冀东水泥、雏鹰农牧等 5 只, 大股东减持标的股票有誉衡药业等 3 只。

图表 7: 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	000031.SZ	中粮地产	2018/6/12	2018/6/8	增持	0.24	0.00	46.71	6.64	6.62	0.15
2	000401.SZ	冀东水泥	2018/6/12	2018/6/11	增持	1.00	0.00	2.00	11.16	11.12	0.72
3	002477.SZ	雏鹰农牧	2018/6/12	2018/6/11	增持	0.56	0.00	40.20	3.46	3.38	-0.86
4	600699.SH	均胜电子	2018/6/12	2018/6/6	增持	0.3456	0	34.039	25.77	25.5203	
5	603188.SH	亚邦股份	2018/6/12	2018/6/11	增持	0.08	0.00	0.30	10.51	10.53	-7.14
6	002437.SZ	誉衡药业	2018/6/12	2018/6/8	减持	0.08	0.00	42.47	5.75	5.87	0.00
7	600067.SH	冠城大通	2018/6/12	2018/6/11	减持	0.4756	0	1.5109			
8	601718.SH	际华集团	2018/6/12	2018/6/8	减持	0.49	0.00	4.51	4.54	4.53	2.05

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 1 只标的股票涉及增发事件, 其中上海电力等 1 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 8：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	600021.SH	上海电力	2018-06-12	董事会预案		定向	7.36	-1.47

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 88 只标的股票涉及分红送转事件，其中有粤电力 A、中国铁建等 2 只股东大会通过，华润三九、华天科技、日海通讯等 10 只为实施公告日，中航飞机、金正大、华夏幸福等 69 只为股权登记日，苏宁环球、七匹狼、力生制药等 7 只为除权除息日。

图表 9：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	000999.SZ	华润三九	2018/6/12	是	0.46	实施公告日	29.08	-1.52	1.58	
2	002185.SZ	华天科技	2018/6/12	是	0.02	实施公告日	5.95	-0.67	0.34	
3	002313.SZ	日海通讯	2018/6/12	是	0.04	实施公告日	28.20	0.00	0.12	
4	002440.SZ	闰土股份	2018/6/12	是	0.45	实施公告日	20.74	-0.96	2.17	0.50
5	600006.SH	东风汽车	2018/6/12	是	0.03	实施公告日	4.29	0.00	0.71	
6	600446.SH	金证股份	2018/6/12	是	0.03	实施公告日	13.37	-0.15	0.23	
7	600549.SH	厦门钨业	2018/6/12	是	0.20	实施公告日	20.78	0.63	0.96	0.30
8	600557.SH	康缘药业	2018/6/12	是	0.06	实施公告日	13.02	-0.53	0.46	
9	600585.SH	海螺水泥	2018/6/12	是	1.20	实施公告日	35.85	1.36	3.35	
10	600894.SH	广日股份	2018/6/12	是	0.14	实施公告日	6.62	-1.05	2.11	
11	000768.SZ	中航飞机	2018/6/15	是	0.09	股权登记日	15.76	0.96	0.54	
12	002470.SZ	金正大	2018/6/15	是	0.08	股权登记日	7.77	-4.07	1.03	
13	600340.SH	华夏幸福	2018/6/15	是	0.90	股权登记日	28.38	2.68	3.17	
14	000402.SZ	金融街	2018/6/14	是	0.30	股权登记日	9.26	-1.59	3.24	
15	000528.SZ	柳工	2018/6/14	是	0.15	股权登记日	9.59	1.27	1.56	
16	000551.SZ	创元科技	2018/6/14	是	0.10	股权登记日	6.58	-0.15	1.52	
17	000630.SZ	铜陵有色	2018/6/14	是	0.02	股权登记日	2.50	0.40	0.80	
18	000970.SZ	中科三环	2018/6/14	是	0.09	股权登记日	10.71	-0.83	0.84	
19	002004.SZ	华邦健康	2018/6/14	是	0.20	股权登记日	5.89	-0.17	3.40	
20	002030.SZ	达安基因	2018/6/14	是	0.03	股权登记日	17.10	-0.58	0.15	0.10
21	002106.SZ	莱宝高科	2018/6/14	是	0.10	股权登记日	6.56	-0.91	1.52	
22	002128.SZ	露天煤业	2018/6/14	是	0.30	股权登记日	9.25	0.43	3.24	
23	002152.SZ	广电运通	2018/6/14	是	0.20	股权登记日	7.04	-0.71	2.84	
24	002344.SZ	海宁皮城	2018/6/14	是	0.12	股权登记日	5.75	0.00	2.09	
25	002662.SZ	京威股份	2018/6/14	是	0.06	股权登记日	4.13	1.72	1.55	
26	002736.SZ	国信证券	2018/6/14	是	0.15	股权登记日	9.94	-0.60	1.51	
27	300024.SZ	机器人	2018/6/14	是	0.05	股权登记日	17.92	-0.06	0.28	
28	300088.SZ	长信科技	2018/6/14	是	0.10	股权登记日	6.33	0.00	1.58	
29	300191.SZ	潜能恒信	2018/6/14	是	0.01	股权登记日	20.08	-1.81	0.05	
30	600033.SH	福建高速	2018/6/14	是	0.12	股权登记日	3.38	-1.17	3.55	
31	600056.SH	中国医药	2018/6/14	是	0.36	股权登记日	20.12	-3.08	1.81	
32	600155.SH	宝硕股份	2018/6/14	是	0.02	股权登记日	7.73	-0.26	0.30	

33	600162.SH	香江控股	2018/6/14	是	0.16	股权登记日	2.98	0.68	5.37	
34	600200.SH	江苏吴中	2018/6/14	是	0.06	股权登记日	9.05	-1.84	0.62	
35	600267.SH	海正药业	2018/6/14	是	0.05	股权登记日	15.78	-0.94	0.32	
36	600350.SH	山东高速	2018/6/14	是	0.18	股权登记日	4.61	-1.28	3.86	
37	600382.SH	广东明珠	2018/6/14	是	0.04	股权登记日	11.44	0.00	0.31	
38	600391.SH	航发科技	2018/6/14	是	0.03	股权登记日	14.92	-1.65	0.20	
39	600458.SH	时代新材	2018/6/14	是	0.05	股权登记日	7.85	3.84	0.64	
40	600519.SH	贵州茅台	2018/6/14	是	11.00	股权登记日	775.73	-0.29	1.42	
41	600548.SH	深高速	2018/6/14	是	0.30	股权登记日	8.60	-0.12	3.49	
42	600643.SH	爱建集团	2018/6/14	是	0.12	股权登记日	9.90	0.20	1.21	
43	600717.SH	天津港	2018/6/14	是	0.15	股权登记日	8.66	-0.23	1.71	
44	600835.SH	上海机电	2018/6/14	是	0.48	股权登记日	20.12	1.98	2.39	
45	600887.SH	伊利股份	2018/6/14	是	0.70	股权登记日	30.87	0.55	2.27	
46	600893.SH	航发动力	2018/6/14	是	0.13	股权登记日	23.80	0.21	0.54	
47	601166.SH	兴业银行	2018/6/14	是	0.65	股权登记日	15.90	0.63	4.09	
48	601179.SH	中国西电	2018/6/14	是	0.05	股权登记日	3.85	-1.53	1.38	
49	601808.SH	中海油服	2018/6/14	是	0.06	股权登记日	10.39	0.00	0.58	
50	601877.SH	正泰电器	2018/6/14	是	0.70	股权登记日	23.84	0.63	2.94	
51	000089.SZ	深圳机场	2018/6/13	是	0.11	股权登记日	8.18	-1.68	1.34	
52	000151.SZ	中成股份	2018/6/13	是	0.25	股权登记日	13.18	1.85	1.90	
53	000400.SZ	许继电气	2018/6/13	是	0.02	股权登记日	8.58	1.66	0.23	
54	000708.SZ	大冶特钢	2018/6/13	是	0.30	股权登记日	10.39	3.38	2.89	
55	000830.SZ	鲁西化工	2018/6/13	是	0.30	股权登记日	19.29	-0.52	1.56	
56	002277.SZ	友阿股份	2018/6/13	是	0.05	股权登记日	5.05	-0.98	0.99	
57	002424.SZ	贵州百灵	2018/6/13	是	0.08	股权登记日	12.89	-2.27	0.62	
58	300257.SZ	开山股份	2018/6/13	是	0.10	股权登记日	18.57	-2.77	0.54	
59	600141.SH	兴发集团	2018/6/13	是	0.20	股权登记日	15.34	-0.39	1.30	0.20
60	600171.SH	上海贝岭	2018/6/13	是	0.08	股权登记日	12.23	-2.55	0.65	
61	600703.SH	三安光电	2018/6/13	是	0.25	股权登记日	20.72	-3.54	1.21	
62	600787.SH	中储股份	2018/6/13	是	0.06	股权登记日	9.19	1.88	0.66	
63	601002.SH	晋亿实业	2018/6/13	是	0.10	股权登记日	7.02	-9.88	1.42	
64	000028.SZ	国药一致	2018/6/12	是	0.30	股权登记日	51.90	-0.54	0.58	
65	000404.SZ	华意压缩	2018/6/12	是	0.03	股权登记日	4.77	-1.45	0.55	
66	000686.SZ	东北证券	2018/6/12	是	0.10	股权登记日	7.00	-0.71	1.43	
67	000900.SZ	现代投资	2018/6/12	是	0.10	股权登记日	4.47	-1.32	2.24	
68	000963.SZ	华东医药	2018/6/12	是	0.72	股权登记日	72.14	-3.43	1.00	0.50
69	000989.SZ	九芝堂	2018/6/12	是	0.40	股权登记日	20.77	0.83	1.93	
70	002051.SZ	中工国际	2018/6/12	是	0.35	股权登记日	15.62	0.00	2.24	
71	300034.SZ	钢研高纳	2018/6/12	是	0.07	股权登记日	10.10	-3.35	0.69	
72	300168.SZ	万达信息	2018/6/12	是	0.04	股权登记日	25.57	-1.12	0.15	
73	600078.SH	澄星股份	2018/6/12	是	0.03	股权登记日	3.98	0.00	0.75	
74	600170.SH	上海建工	2018/6/12	是	0.14	股权登记日	3.40	0.89	3.97	
75	600298.SH	安琪酵母	2018/6/12	是	0.35	股权登记日	37.02	-3.17	0.95	
76	600435.SH	北方导航	2018/6/12	是	0.03	股权登记日	9.08	-1.20	0.28	
77	600466.SH	蓝光发展	2018/6/12	是	0.10	股权登记日	9.45	-2.07	1.06	0.40
78	600499.SH	科达洁能	2018/6/12	是	0.05	股权登记日	7.82	-1.01	0.64	

79	600667.SH	太极实业	2018/6/12	是	0.10	股权登记日	7.81	-1.01	1.28	
80	000539.SZ	粤电力 A	2018/6/12	是		股东大会通过	4.51	-1.10		
81	601186.SH	中国铁建	2018/6/12	是		股东大会通过	9.01	0.78		
82	000718.SZ	苏宁环球	2018/6/12	是	0.10	除权除息日	4.02	2.03	2.49	
83	002029.SZ	七匹狼	2018/6/12	是	0.10	除权除息日	8.99	-1.21	1.11	
84	002393.SZ	力生制药	2018/6/12	是	0.30	除权除息日	27.78	-1.45	1.08	
85	300001.SZ	特锐德	2018/6/12	是	0.05	除权除息日	12.56	-0.08	0.40	
86	600310.SH	桂东电力	2018/6/12	是	0.03	除权除息日	4.92	0.61	0.51	
87	601218.SH	吉鑫科技	2018/6/12	是	0.01	除权除息日	2.75	0.00	0.36	
88	601238.SH	广汽集团	2018/6/12	是	0.43	除权除息日	19.08	-0.73	2.25	0.40

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

今日共有多氟多等 1 只标的股票发布业绩预告。

图表 10: 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	002407.SZ	多氟多	半年度预告	续盈	-25.00	16.11	-0.49

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 个交易日共有东方明珠、欧比特、中国核电等 10 只标的股票涉及限售股解禁。

图表 11: 未来七个交易日标的股票限售股解禁

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	600637.SH	东方明珠	2018/6/12	13828.38	5.56	定向增发机构配售股份	16.74	-2.84
2	300053.SZ	欧比特	2018/6/12	2906.25	6.25	定向增发机构配售股份	12.62	-1.56
3	601985.SH	中国核电	2018/6/12	1132418.00	267.00	首发原股东限售股份	5.83	0.69
4	600120.SH	浙江东方	2018/6/13	616.07	1.22	定向增发机构配售股份	18.61	-1.69
5	002074.SZ	国轩高科	2018/6/13	10044.05	10.51	定向增发机构配售股份	16.32	-1.45
6	600297.SH	广汇汽车	2018/6/19	475874.37	198.96	定向增发机构配售股份	6.38	-0.47
7	601669.SH	中国电建	2018/6/19	415463.35	37.28	定向增发机构配售股份	5.60	-0.71
8	600409.SH	三友化工	2018/6/19	18693.69	10.10	定向增发机构配售股份	9.27	-0.64
9	600604.SH	市北高新	2018/6/19	29165.47	27.98	定向增发机构配售股份	5.19	-0.95
10	601009.SH	南京银行	2018/6/19	41270.47	5.11	定向增发机构配售股份	7.94	0.13

数据来源: Wind、信达证券研发中心

三、事件投资组合操作

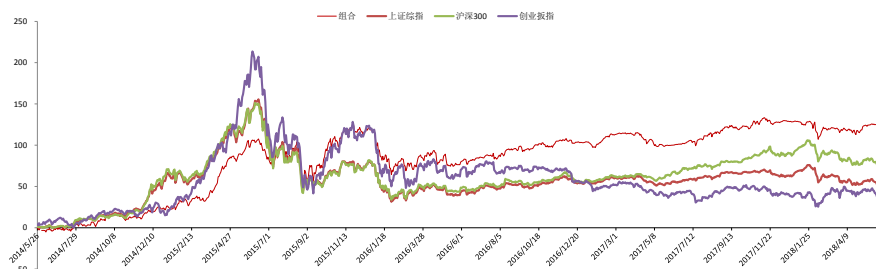
说明: 本事件投资组合是由信达证券事件选股模型针对本报告第一、第二部分事件内容筛选而形成。组合单只股票权重按总资产 3% 计, 开始日期为 2014 年 5 月 23 日, 不考虑交易费用, 每日盘前制定当日投资操作, 股票买入与卖出的价格按当日均价执行。

1. 组合历史收益

上一交易日组合收益率为-0.07%, 至 2018 年 6 月 11 日组合累计收益率为 124.03%,

分别超越上证综指、沪深 300 及创业板指 73、46.64 及 91.02 个百分点。

图表 12: 组合历史收益曲线



数据来源: Wind、信达证券研发中心

图表 13: 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	-0.02	-0.13	1.99	-1.77	11.96	10.24
上证综指	-0.73	-3.37	-6.69	-6.70	-3.34	-1.64
沪深 300	0.25	-2.37	-6.36	-4.81	5.70	14.20
创业板指	-1.22	-9.01	-5.41	-4.97	-5.99	-13.94

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: 无。

图表 14: 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					

数据来源: Wind、信达证券研发中心

2) 今日拟平仓股票

今日无拟平仓股票。

图表 15: 今日拟平仓股票

序号	股票代码	股票简称	买入日期	权重(%)	持有期收益率(%)
1					

数据来源: Wind、信达证券研发中心

3. 昨日组合操作回顾

1) 昨日建仓股票

昨日无成功建仓股票。

图表 16: 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 17：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 2018 年 6 月 11 日收盘，组合共有成分股 9 只，仓位 27%。

图表 18：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	000739.SZ	普洛药业	2018/5/21	7.42	3.00	7.66	3.22	7.62
2	601229.SH	上海银行	2018/5/21	15.98	3.00	15.93	-0.29	4.11
3	000046.SZ	泛海控股	2018/5/22	7.11	3.00	6.96	-2.07	2.94
4	600661.SH	新南洋	2018/5/25	30.37	3.00	28.90	-4.83	-1.60
5	600395.SH	盘江股份	2018/5/28	6.27	3.00	6.17	-1.55	1.27
6	002154.SZ	报喜鸟	2018/5/29	3.38	3.00	3.24	-4.28	-1.66
7	000690.SZ	宝新能源	2018/6/1	8.08	3.00	7.99	-1.10	0.28
8	000739.sz	普洛药业	2018/6/5	7.26	3.00	7.66	5.51	6.75
9	600418.SH	江淮汽车	2018/6/7	7.35	3.00	7.32	-0.42	1.58

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