

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21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 9378.24 亿元(-0.64%), 其中融资余额规模为 9317.78 亿元(-0.61%), 融券余额规模为 60.46 亿元(-4.55%)。从融资规模来看, 上一交易日沪深两市融资买入额为 251.46 亿元(-26.86%), 融资偿还额为 309.02 亿元(-44.71%)。
- 上一交易日, 市场指数中小板指(+1.09%)表现最好, 上证综指(+0.27%)表现最弱; 从行业来看, 食品饮料(+2.91%)、国防军工(+2.56%)、医药生物(+2.44%)、钢铁(+2.42%)、房地产(+1.37%)等行业表现较好, 交通运输(-0.81%)、银行(-0.7%)、通信(-0.51%)、非银金融(-0.48%)、有色金属(-0.46%)等行业表现较弱。
- 两融标的股票中, 涨幅前五名为: 中钢国际(+10.09%)、中航电子(+9.99%)、远望谷(+9.99%)、泰合健康(+9.98%)和金杯汽车(+9.95%); 跌幅前五名为: 锦富技术(-10.07%)、美尔雅(-9.99%)、白云机场(-9.98%)、中兴通讯(-9.98%)和长城影视(-9.96%); 五日量比前五名为: 卫宁健康(14.29)、华业资本(4.96)、唐山港(4.71)、大湖股份(3.5)和农产品(3.19)。
- 上一交易日, 发生大宗交易的标的股票有科力远、永泰能源、南方航空等 21 只。
- 今日共有 51 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泛海控股、吉林敖东、得润电子等 14 只, 大股东减持标的股票有航发控制等 3 只。
- 今日披露, 共有 1 只标的股票涉及增发事件, 其中深赤湾 A 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 103 只标的股票涉及分红送转事件, 其中有平安银行、华联控股、粤电力 A 等 8 只股东大会通过, 华联控股、粤电力 A、兴蓉环境等 16 只为实施公告日, 深振业 A、平安银行、华联控股等 64 只为股权登记日, 宝新能源、超声电子、华工科技等 15 只为除权除息日。
- 今日无标的股票业绩报告发布。
- 未来 7 个交易日共有亚泰集团、金证股份、凯乐科技等 9 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。
- 今日拟平仓股票有泛海控股等 1 只。
- 上一交易日组合收益率为 0.48%, 至 2018 年 6 月 20 日组合累计收益率为 118.92%, 分别超越上证综指、沪深 300 及创业板指 74.67、48.31 及 95.74 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.....	15
6. 标的股票限售股解禁.....	15
三、事件投资组合操作.....	15
1. 组合历史收益.....	15
2. 今日组合操作.....	16
3. 昨日组合操作回顾.....	16
4. 组合成分股.....	17

图表目录

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

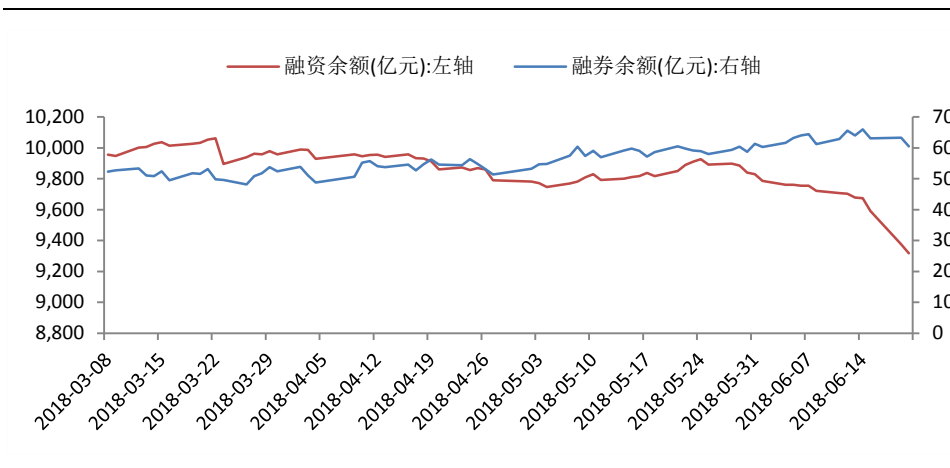
图表 23: 昨日建仓股票	16
图表 24: 昨日平仓股票	17
图表 25: 组合成分股	17

一、上一交易日市场回顾

1. 融资融券规模及主要市场指数表现

上一交易日，沪深两市融资融券余额规模为 9378.24 亿元(-0.64%)，其中融资余额规模为 9317.78 亿元(-0.61%)，融券余额规模为 60.46 亿元(-4.55%)。

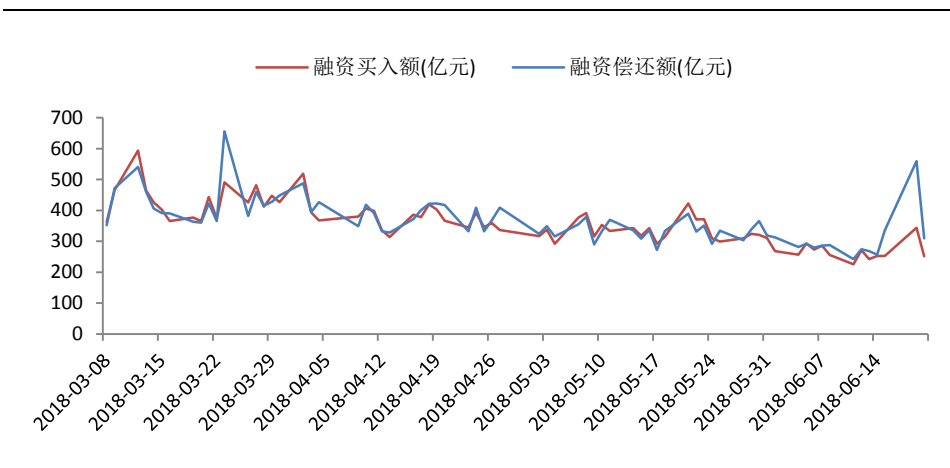
图表 1：近三月每日融资融券余额规模（亿元）



数据来源：Wind、信达证券研发中心

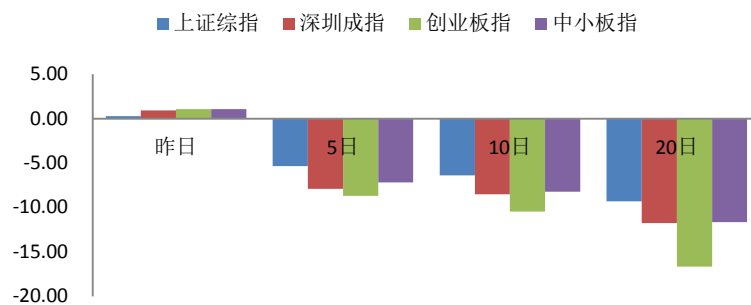
从融资规模来看，上一交易日沪深两市融资买入额为 251.46 亿元(-26.86%)，融资偿还额为 309.02 亿元(-44.71%)。

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，市场指数中中小板指表现较好，上涨 1.09%，上证综指表现最弱，上涨 0.27%；从 5 日涨跌幅看，上证综指表现较好，下跌 5.33%，创业板指表现最弱，下跌 8.7%；从 10 日涨跌幅看，上证综指表现较好，下跌 6.37%，创业板指表现最弱，下跌 10.44%；从 20 日涨跌幅看，上证综指表现较好，下跌 9.29%，创业板指表现最弱，下跌 16.64%。

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，银行(+1.09%)、交通运输(+0.94%)、非银金融(+0.66%)等行业增速居前，医药生物(-2.81%)、国防军工(-3.41%)、食品饮料(-5.01%)等行业增速靠后。

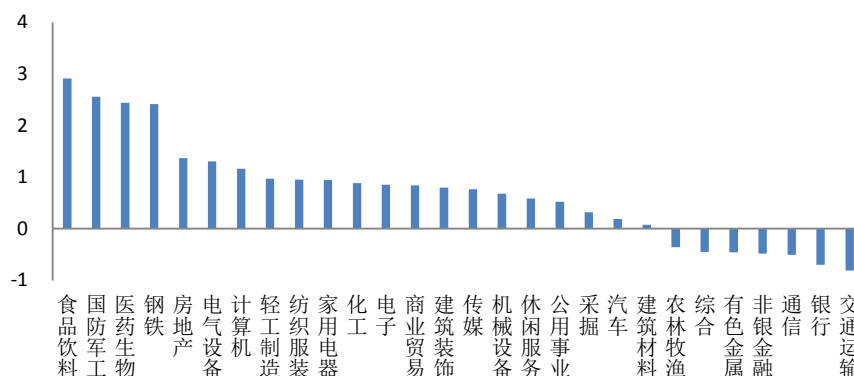
图表 4：上一交易日两融标的股票分行业融资余额占流通市值比例及增速（%）

序号	代码	行业	融资余额占流通市值比例(%)	占比增速(%)
1	801780.SI	银行	1.08	1.09
2	801170.SI	交通运输	1.86	0.94
3	801790.SI	非银金融	2.80	0.66
4	801770.SI	通信	7.24	0.35
5	801880.SI	汽车	2.23	0.19
6	801030.SI	化工	3.01	-0.36
7	801710.SI	建筑材料	3.28	-0.39
8	801020.SI	采掘	0.90	-0.44
9	801210.SI	休闲服务	1.97	-0.48
10	801050.SI	有色金属	6.43	-0.60
11	801010.SI	农林牧渔	3.28	-0.66
12	801890.SI	机械设备	4.03	-0.79
13	801720.SI	建筑装饰	2.54	-0.86
14	801160.SI	公用事业	2.84	-0.94
15	801080.SI	电子	4.64	-1.12
16	801230.SI	综合	8.80	-1.15
17	801750.SI	计算机	8.14	-1.41
18	801140.SI	轻工制造	6.42	-1.65
19	801180.SI	房地产	3.55	-1.74
20	801040.SI	钢铁	2.77	-1.81
21	801760.SI	传媒	5.49	-1.90
22	801110.SI	家用电器	1.80	-2.04
23	801200.SI	商业贸易	5.14	-2.04
24	801130.SI	纺织服装	2.68	-2.48
25	801730.SI	电气设备	4.34	-2.49
26	801150.SI	医药生物	2.70	-2.81
27	801740.SI	国防军工	4.90	-3.41
28	801120.SI	食品饮料	1.01	-5.01

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,食品饮料(+2.91%)、国防军工(+2.56%)、医药生物(+2.44%)、钢铁(+2.42%)、房地产(+1.37%)等行业表现较好,交通运输(-0.81%)、银行(-0.7%)、通信(-0.51%)、非银金融(-0.48%)、有色金属(-0.46%)等行业表现较弱。

图表 5: 申万行业上一交易日涨跌幅 (%)

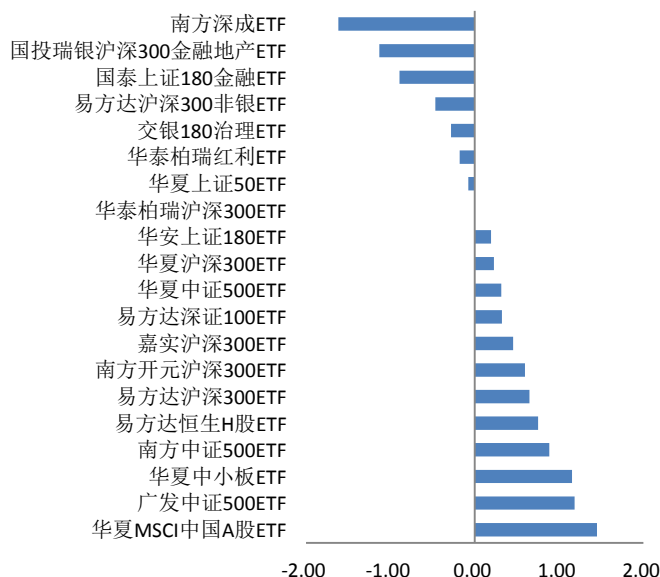


数据来源: Wind、信达证券研发中心

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:华夏 MSCI 中国 A 股 ETF(+1.45%)、广发中证 500ETF (+1.18%) 及华夏中小板 ETF (+1.15%);跌幅前三名为:南方深成 ETF (-1.62%)、国投瑞银沪深 300 金融地产 ETF (-1.13%) 及国泰上证 180 金融 ETF (-0.89%)。

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:中钢国际(+10.09%)、中航电子(+9.99%)、远望谷(+9.99%)、泰合健康(+9.98%)和金杯汽车(+9.95%);跌幅前五名为:锦富技术(-10.07%)、美尔雅(-9.99%)、白云机场(-9.98%)、中兴通讯(-9.98%)

和长城影视 (-9.96%)。

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	000928.SZ	中钢国际	10.09	0.86	300128.SZ	锦富技术	-10.07	1.05
2	600372.SH	中航电子	9.99	1.46	600107.SH	美尔雅	-9.99	3.16
3	002161.SZ	远望谷	9.99	1.28	600004.SH	白云机场	-9.98	1.27
4	000790.SZ	泰合健康	9.98	0.89	000063.SZ	中兴通讯	-9.98	2.19
5	600609.SH	金杯汽车	9.95	1.04	002071.SZ	长城影视	-9.96	0.24
6	601155.SH	新城控股	9.58	1.39	300168.SZ	万达信息	-9.34	2.76
7	600240.SH	华业资本	9.55	4.96	600187.SH	国中水务	-9.28	2.91
8	600380.SH	健康元	9.19	3.06	600257.SH	大湖股份	-9.13	3.50
9	600801.SH	华新水泥	8.04	1.28	600620.SH	天宸股份	-8.63	2.98
10	300133.SZ	华策影视	7.94	1.24	600777.SH	新潮能源	-8.46	2.82
11	002595.SZ	豪迈科技	7.85	2.07	000829.SZ	天音控股	-8.18	1.43
12	300015.SZ	爱尔眼科	7.76	1.87	600100.SH	同方股份	-7.73	3.01
13	000860.SZ	顺鑫农业	7.68	1.01	000839.SZ	中信国安	-7.39	2.22
14	600199.SH	金种子酒	7.65	2.81	002538.SZ	司尔特	-7.37	2.46
15	600068.SH	葛洲坝	7.10	2.35	300253.SZ	卫宁健康	-7.28	14.29
16	300122.SZ	智飞生物	7.04	1.43	600765.SH	中航重机	-6.75	0.00
17	000812.SZ	陕西金叶	6.67	1.56	002130.SZ	沃尔核材	-5.97	2.31
18	002268.SZ	卫士通	6.44	1.04	600012.SH	皖通高速	-5.64	1.82
19	600559.SH	老白干酒	6.37	0.99	002041.SZ	登海种业	-5.45	1.46
20	600197.SH	伊力特	6.27	0.98	600354.SH	敦煌种业	-4.27	1.46

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：卫宁健康（14.29）、华业资本（4.96）、唐山港（4.71）、大湖股份（3.5）和农产品（3.19）。

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	300253.SZ	卫宁健康	-7.28	14.29
2	600240.SH	华业资本	9.55	4.96
3	601000.SH	唐山港	-1.16	4.71
4	600257.SH	大湖股份	-9.13	3.50
5	000061.SZ	农产品	-4.14	3.19
6	600107.SH	美尔雅	-9.99	3.16
7	600380.SH	健康元	9.19	3.06
8	600100.SH	同方股份	-7.73	3.01
9	600620.SH	天宸股份	-8.63	2.98
10	002138.SZ	顺络电子	0.85	2.96
11	300003.SZ	乐普医疗	2.87	2.96
12	601901.SH	方正证券	4.55	2.95
13	600187.SH	国中水务	-9.28	2.91
14	600777.SH	新潮能源	-8.46	2.82

15	600548.SH	深高速	2.17	2.81
16	600199.SH	金种子酒	7.65	2.81
17	300168.SZ	万达信息	-9.34	2.76
18	002648.SZ	卫星石化	-3.55	2.54
19	002538.SZ	司尔特	-7.37	2.46
20	600478.SH	科力远	-1.48	2.37

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: 中兴通讯(102.59%)、锦富技术(101.17%)、长城影视(100.78%)、白云机场(99.99%)、国中水务(73.53%)。

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	000063.SZ	中兴通讯	-9.98	102.59	36.75
2	300128.SZ	锦富技术	-10.07	101.17	17.32
3	002071.SZ	长城影视	-9.96	100.78	11.68
4	600004.SH	白云机场	-9.98	99.99	277.02
5	600187.SH	国中水务	-9.28	73.53	35.04
6	601991.SH	大唐发电	2.33	45.58	16.24
7	601800.SH	中国交建	0.75	45.44	65.06
8	601886.SH	江河集团	3.75	44.65	12.04
9	600261.SH	阳光照明	4.43	42.82	12.32
10	000726.SZ	鲁泰 A	5.73	41.51	25.89
11	600307.SH	酒钢宏兴	3.40	39.24	27.92
12	600094.SH	大名城	-0.90	38.83	4.83
13	002521.SZ	齐峰新材	1.28	36.53	15.42
14	002050.SZ	三花智控	3.49	36.39	70.04
15	600017.SH	日照港	1.61	36.10	13.06
16	601880.SH	大连港	1.60	35.69	12.41
17	601155.SH	新城控股	9.58	35.57	256.91
18	601158.SH	重庆水务	0.55	34.86	4.70
19	002064.SZ	华峰氨纶	3.36	32.29	9.24
20	600177.SH	雅戈尔	2.13	32.11	23.62

数据来源: Wind、信达证券研发中心

上一交易日, 两融标的券中开盘金额流入率最高的前五名是: 白云机场(64.81%)、长城影视(58.3%)、大唐发电(40.97%)、锦富技术(35.74%)、航天机电(32.46%); 尾盘金额流入率最高的前五名是: 国中水务(27.26%)、江河集团(20.07%)、爱建集团(19.96%)、龙净环保(15.6%)、宜华生活(14.89%)。

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	600004.SH	白云机场	-9.98	64.81	183.13	600187.SH	国中水务	-9.28	27.26	13.01
2	002071.SZ	长城影视	-9.96	58.30	6.81	601886.SH	江河集团	3.75	20.07	5.43
3	601991.SH	大唐发电	2.33	40.97	14.61	600643.SH	爱建集团	0.42	19.96	26.23
4	300128.SZ	锦富技术	-10.07	35.74	6.19	600388.SH	龙净环保	0.30	15.60	24.55
5	600151.SH	航天机电	0.00	32.46	14.35	600978.SH	宜华生活	0.43	14.89	8.66
6	601311.SH	骆驼股份	1.07	31.17	7.50	600307.SH	酒钢宏兴	3.40	13.86	9.87

7	600310.SH	桂东电力	3.41	30.86	4.06	000063.SZ	中兴通讯	-9.98	13.67	5.02
8	600094.SH	大名城	-0.90	27.67	3.55	600273.SH	嘉化能源	2.06	12.42	10.34
9	600017.SH	日照港	1.61	24.33	8.82	002064.SZ	华峰氨纶	3.36	11.16	3.39
10	000063.SZ	中兴通讯	-9.98	23.21	8.53	300128.SZ	锦富技术	-10.07	10.66	1.85
11	600100.SH	同方股份	-7.73	22.66	94.92	000829.SZ	天音控股	-8.18	10.63	6.90
12	000767.SZ	漳泽电力	1.69	21.76	2.72	002385.SZ	大北农	-0.38	10.05	11.29
13	600663.SH	陆家嘴	4.81	21.72	12.29	600382.SH	广东明珠	-0.79	9.24	4.81
14	300253.SZ	卫宁健康	-7.28	20.29	243.08	600545.SH	卓郎智能	-0.13	8.77	2.67
15	601021.SH	春秋航空	-1.63	20.20	20.36	600337.SH	美克家居	0.70	8.67	4.43
16	600998.SH	九州通	1.19	19.97	12.00	600261.SH	阳光照明	4.43	8.15	2.37
17	600648.SH	外高桥	0.61	18.42	4.95	002521.SZ	齐峰新材	1.28	7.98	3.42
18	600015.SH	华夏银行	0.00	18.33	29.43	300168.SZ	万达信息	-9.34	7.96	76.29
19	600229.SH	城市传媒	2.24	18.21	2.77	002266.SZ	浙富控股	0.54	7.71	2.40
20	002028.SZ	思源电气	1.04	17.77	9.36	600267.SH	海正药业	4.79	7.51	13.04

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全柴动力(27.44%)、数码科技(22.61%)、创元科技(22.42%)等,融资余额占流通市值比例增速前十名白云机场(+27.84%)、中国太保(+12.75%)、苏泊尔(+11.38%)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	27.44	600004.SH	白云机场	27.84
2	300079.SZ	数码科技	22.61	601601.SH	中国太保	12.75
3	000551.SZ	创元科技	22.42	002032.SZ	苏泊尔	11.38
4	300157.SZ	恒泰艾普	20.28	002538.SZ	司尔特	10.52
5	300355.SZ	蒙草生态	20.24	300253.SZ	卫宁健康	10.46
6	600692.SH	亚通股份	20.05	002071.SZ	长城影视	10.07
7	000731.SZ	四川美丰	19.91	300168.SZ	万达信息	10.04
8	002067.SZ	景兴纸业	19.87	600257.SH	大湖股份	9.52
9	600470.SH	六国化工	19.81	601111.SH	中国国航	9.32
10	002148.SZ	北纬科技	19.79	000063.SZ	中兴通讯	8.23

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科力远、永泰能源、南方航空等 21 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	600478.SH	科力远	4.26	4.73	-9.94	4.66	270.20	1151.06
2	600157.SH	永泰能源	1.62	1.62	0.00	1.61	314.50	509.49
3	600029.SH	南方航空	10.36	10.91	-5.04	10.52	20.00	207.20
4	600067.SH	冠城大通	4.10	4.05	1.23	4.05	1682.00	6896.20
5	600498.SH	烽火通信	20.97	23.30	-10.00	23.40	450.00	9436.50
6	601318.SH	中国平安	60.61	62.09	-2.38	61.85	5000.00	303050.00

7	601718.SH	际华集团	3.64	4.04	-9.90	4.03	48.84	177.78
8	600518.SH	康美药业	23.30	23.10	0.87	23.30	155.90	3632.47
9	600967.SH	内蒙一机	9.90	10.99	-9.92	11.43	2891.88	28629.54
10	000887.SZ	中鼎股份	13.82	14.34	-3.63	14.55	115.00	1589.30
11	000932.SZ	华菱钢铁	8.88	8.61	3.14	9.13	237.41	2108.20
12	002050.SZ	三花智控	17.79	17.19	3.49	17.79	163.77	2913.51
13	000581.SZ	威孚高科	22.53	22.31	0.99	22.53	24.25	546.35
14	000046.SZ	泛海控股	6.04	6.24	-3.21	6.23	145.50	878.82
15	000333.SZ	美的集团	49.16	54.62	-10.00	55.16	158.00	7826.67
16	002099.SZ	海翔药业	4.41	4.82	-8.51	4.90	215.31	949.52
17	002415.SZ	海康威视	37.82	37.48	0.91	37.82	62.75	2373.18
18	300088.SZ	长信科技	5.58	5.53	0.90	5.58	42.15	235.20
19	002405.SZ	四维图新	17.70	19.45	-9.00	19.76	107.00	1893.90
20	002221.SZ	东华能源	9.53	10.10	-5.64	10.03	645.55	6152.10
21	002250.SZ	联化科技	7.90	8.78	-10.02	9.28	126.00	995.40

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 51 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 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	000426.SZ	兴业矿业	停牌	2018-06-19	2	-3.51	重大事项
2	002408.SZ	齐翔腾达	停牌	2018-06-19	2	-3.51	重大资产重组
3	002573.SZ	清新环境	停牌	2018-06-19	2	-3.51	拟披露重大事项
4	300072.SZ	三聚环保	停牌	2018-06-19	2	-3.51	拟披露重大事项
5	600122.SH	宏图高科	停牌	2018-06-19	2	-3.51	拟筹划重大资产重组
6	600146.SH	商赢环球	停牌	2018-06-19	2	-3.51	重大资产重组
7	002470.SZ	金正大	停牌	2018-06-15	6	-4.22	重大事项
8	002477.SZ	雏鹰农牧	停牌	2018-06-14	7	-4.40	重大事项
9	002437.SZ	誉衡药业	停牌	2018-06-11	10	-4.94	重大资产重组
10	601727.SH	上海电气	停牌	2018-06-06	15	-6.37	拟筹划重大资产重组
11	002450.SZ	康得新	停牌	2018-06-04	17	-5.18	重大资产重组
12	300090.SZ	盛运环保	停牌	2018-06-04	17	-5.18	拟披露重大事项
13	002431.SZ	棕榈股份	停牌	2018-05-30	22	-6.56	重大事项
14	600175.SH	美都能源	停牌	2018-05-30	22	-6.56	拟筹划重大资产重组
15	600811.SH	东方集团	停牌	2018-05-30	22	-6.56	重要事项未公告
16	002310.SZ	东方园林	停牌	2018-05-25	27	-7.57	重大资产重组
17	601118.SH	海南橡胶	停牌	2018-05-24	28	-7.99	拟筹划重大资产重组
18	600800.SH	天津磁卡	停牌	2018-05-21	31	-8.69	拟筹划重大资产重组
19	002369.SZ	卓翼科技	停牌	2018-05-14	38	-7.83	拟披露重大事项
20	601390.SH	中国中铁	停牌	2018-05-07	45	-5.67	重大资产重组
21	002011.SZ	盾安环境	停牌	2018-05-02	50	-5.40	重大资产重组

22	600293.SH	三峡新材	停牌	2018-05-02	50	-5.40	重要事项未公告
23	600750.SH	江中药业	停牌	2018-05-02	50	-5.40	重大资产重组
24	000825.SZ	太钢不锈	停牌	2018-04-16	66	-7.70	重大资产重组
25	600490.SH	鹏欣资源	停牌	2018-04-16	66	-7.70	重大资产重组
26	002051.SZ	中工国际	停牌	2018-04-09	73	-6.88	重大资产重组
27	600335.SH	国机汽车	停牌	2018-04-03	79	-7.82	重大资产重组
28	002002.SZ	鸿达兴业	停牌	2018-03-27	86	-6.96	重大资产重组
29	600022.SH	山东钢铁	停牌	2018-03-27	86	-6.96	重大资产重组
30	600158.SH	中体产业	停牌	2018-03-27	86	-6.96	拟筹划重大资产重组
31	600759.SH	洲际油气	停牌	2018-03-27	86	-6.96	重大资产重组
32	002210.SZ	飞马国际	停牌	2018-03-26	87	-7.52	拟披露重大事项
33	600318.SH	新力金融	停牌	2018-03-23	90	-10.66	重大事项
34	600880.SH	博瑞传播	停牌	2018-03-06	107	-10.48	重大事项
35	000506.SZ	中润资源	停牌	2018-02-28	113	-11.43	重大资产重组
36	002252.SZ	上海莱士	停牌	2018-02-23	118	-10.79	重大资产重组
37	000793.SZ	华闻传媒	停牌	2018-02-01	140	-16.23	重大资产重组
38	600568.SH	中珠医疗	停牌	2018-02-01	140	-16.23	重大资产重组
39	300146.SZ	汤臣倍健	停牌	2018-01-31	141	-16.41	重大资产重组
40	000616.SZ	海航投资	停牌	2018-01-24	148	-17.79	重大资产重组
41	600515.SH	海航基础	停牌	2018-01-23	149	-16.73	重大资产重组
42	600086.SH	东方金钰	停牌	2018-01-19	153	-16.09	重大资产重组
43	000415.SZ	渤海金控	停牌	2018-01-17	155	-15.16	重大资产重组
44	600751.SH	海航科技	停牌	2018-01-12	160	-14.88	拟筹划重大资产重组
45	600221.SH	海航控股	停牌	2018-01-10	162	-14.59	重大资产重组
46	002005.SZ	德豪润达	停牌	2018-01-02	170	-11.84	重大资产重组
47	000156.SZ	华数传媒	停牌	2017-12-26	177	-11.12	重大资产重组
48	000022.SZ	深赤湾 A	停牌	2017-11-20	213	-13.81	重大资产重组
49	000939.SZ	凯迪生态	停牌	2017-11-16	217	-14.31	重大资产重组
50	000540.SZ	中天金融	停牌	2017-08-21	304	-10.80	重大资产重组
51	600485.SH	信威集团	停牌	2016-12-26	542	-6.25	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泛海控股、吉林敖东、得润电子等 14 只, 大股东减持标的股票有航发控制等 3 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 (%)	交易均价	变动期间股票均价	前涨跌幅 (%)
1	000046.SZ	泛海控股	2018/6/21	2018/6/20	增持	0.04	0.00	67.74	6.19	6.11	-0.16
2	000623.SZ	吉林敖东	2018/6/21	2018/6/20	增持	0.00	0.00	0.00	17.32	17.23	1.77
3	000623.SZ	吉林敖东	2018/6/21	2018/6/20	增持	0.00	0.00	0.01	17.36	17.23	1.77
4	000623.SZ	吉林敖东	2018/6/21	2018/6/20	增持	0.00	0.00	0.00	17.33	17.23	1.77
5	000623.SZ	吉林敖东	2018/6/21	2018/6/20	增持	0.0018	0	0.0073	17.35	17.2322	

6	000623.SZ	吉林敖东	2018/6/21	2018/6/20	增持	0.0018	0	0.0028	17.38	17.2322	
7	000623.SZ	吉林敖东	2018/6/21	2018/6/20	增持	0.03	0.00	0.17	17.23	17.23	1.77
8	000623.SZ	吉林敖东	2018/6/21	2018/6/20	增持	0.0164	0	0.0589	17.34	17.2322	
9	000623.SZ	吉林敖东	2018/6/21	2018/6/20	增持	0.00	0.00	0.01	17.36	17.23	1.77
10	002055.SZ	得润电子	2018/6/21	2018/6/20	增持	0.05	0.00	3.61	16.11	16.05	1.07
11	002074.SZ	国轩高科	2018/6/21	2018/6/20	增持	0.04	0.00	0.05		13.34	4.36
12	002074.SZ	国轩高科	2018/6/21	2018/6/19	增持	0.02	0.00	0.03		13.42	4.36
13	002108.SZ	沧州明珠	2018/6/21	2018/6/20	增持	0.03	0.00	0.03	4.39	4.31	-2.02
14	002108.SZ	沧州明珠	2018/6/21	2018/6/20	增持	0.08	0.00	0.17	4.38	4.31	-2.02
15	002138.SZ	顺络电子	2018/6/21	2018/6/20	增持	0.0706	0.00	15.67	15.22	14.48	
16	002138.SZ	顺络电子	2018/6/21	2018/6/20	增持	0.02	0.00	0.10	14.20	14.48	0.85
17	002138.SZ	顺络电子	2018/6/21	2018/6/20	增持	0.13	0.00	0.27	15.32	14.48	0.85
18	300003.SZ	乐普医疗	2018/6/21	2018/6/20	增持	0.00	0.00	0.08	32.31	33.26	2.87
19	300055.SZ	万邦达	2018/6/21	2018/6/20	增持	0.0858	0	0.0858	10.78	10.9461	
20	600039.SH	四川路桥	2018/6/21	2018/6/20	增持	0.06	0.00	41.05	3.05	3.05	3.68
21	600177.SH	雅戈尔	2018/6/21	2018/6/20	增持	1.49	0.00	30.50		8.63	2.13
22	600771.SH	广誉远	2018/6/21	2018/6/20	增持	1.9999	0	3.3698	42.9613	50.7246	
23	600827.SH	百联股份	2018/6/21	2018/6/15	增持	0.00	0.00	0.00	10.60	10.58	1.10
24	600998.SH	九州通	2018/6/21	2018/6/20	增持	0.0175	0.00	23.08	16.94	18.54	
25	601000.SH	唐山港	2018/6/21	2018/6/20	增持	0.36	0.00	44.88	2.52	2.47	-1.16
26	000738.SZ	航发控制	2018/6/21	2016/12/26	减持	0.08	100.00	9.28	25.76	25.84	5.76
27	000738.SZ	航发控制	2018/6/21	2016/9/27	减持	0.22	100.00	9.36	27.44	28.40	5.76
28	000738.SZ	航发控制	2018/6/21	2016/8/31	减持	0.0262	100.00	9.58	30.19	30.19	
29	000932.SZ	华菱钢铁	2018/6/21	2018/6/20	减持	0.0787	100.00	5.00	8.88	8.90	
30	600446.SH	金证股份	2018/6/21	2018/6/20	减持	1.01	0.00	0.00			0.90

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,其中深赤湾 A 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 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	000022.SZ	深赤湾 A	2018-06-21	董事会预案	21.46	定向	22.82	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 103 只标的股票涉及分红送转事件,其中有平安银行、华联控股、粤电力 A 等 8 只股东大会通过,华联控股、粤电力 A、兴蓉环境等 16 只为实施公告日,深振业 A、平安银行、华联控股等 64 只为股权登记日,宝新能源、超声电子、华工科技等 15 只为除权除息日。

图表 16: 未来七个交易日发生分红送转事件标的股票

序号	股票代码	股票简称	时间	是否分红	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	000006.SZ	深振业 A	2018/6/21		0.18	股权登记日	6.19	-0.16	2.92	

2	000001.SZ	平安银行	2018/6/21			股东大会通过	9.91	0.41		
3	000036.SZ	华联控股	2018/6/21	是	0.50	实施公告日	6.58	0.77	7.60	
4	000539.SZ	粤电力 A	2018/6/21	是	0.08	实施公告日	4.39	1.39	1.82	
5	000598.SZ	兴蓉环境	2018/6/21	是	0.08	实施公告日	4.12	0.73	1.89	
6	000811.SZ	冰轮环境	2018/6/21	是	0.08	实施公告日	5.13	-1.72	1.56	
7	002311.SZ	海大集团	2018/6/21	是	0.25	实施公告日	22.72	1.43	1.10	
8	300079.SZ	数码科技	2018/6/21	是	0.01	实施公告日	3.53	2.62	0.27	
9	300113.SZ	顺网科技	2018/6/21	是	0.20	实施公告日	15.59	2.77	1.28	
10	600015.SH	华夏银行	2018/6/21	是	0.15	实施公告日	7.74	0.00	1.95	
11	600256.SH	广汇能源	2018/6/21	是	0.05	实施公告日	3.74	2.47	1.34	
12	600389.SH	江山股份	2018/6/21	是	0.26	实施公告日	19.15	2.24	1.36	
13	600783.SH	鲁信创投	2018/6/21	是	0.05	实施公告日	9.78	0.82	0.51	
14	600884.SH	杉杉股份	2018/6/21	是	0.06	实施公告日	21.16	6.01	0.28	
15	601006.SH	大秦铁路	2018/6/21	是	0.47	实施公告日	8.95	0.00	5.25	
16	601588.SH	北辰实业	2018/6/21	是	0.11	实施公告日	3.58	-0.83	3.07	
17	601669.SH	中国电建	2018/6/21	是	0.09	实施公告日	5.55	1.28	1.67	
18	601929.SH	吉视传媒	2018/6/21	是	0.03	实施公告日	2.20	0.92	1.14	
19	600592.SH	龙溪股份	2018/6/27	是	0.10	股权登记日	6.03	-0.50	1.66	
20	000012.SZ	南玻 A	2018/6/26	是	0.05	股权登记日	5.68	0.71	0.88	0.15
21	000166.SZ	申万宏源	2018/6/26	是	0.05	股权登记日	4.41	2.08	1.13	
22	000531.SZ	穗恒运 A	2018/6/26	是	0.10	股权登记日	5.15	0.59	1.94	
23	000709.SZ	河钢股份	2018/6/26	是	0.10	股权登记日	3.05	3.74	3.28	
24	000726.SZ	鲁泰 A	2018/6/26	是	0.50	股权登记日	10.88	5.73	4.60	
25	002007.SZ	华兰生物	2018/6/26	是	0.30	股权登记日	32.86	2.05	0.91	
26	002025.SZ	航天电器	2018/6/26	是	0.25	股权登记日	21.01	1.50	1.19	
27	002579.SZ	中京电子	2018/6/26	是	0.10	股权登记日	8.33	5.04	1.20	
28	600111.SH	北方稀土	2018/6/26	是	0.04	股权登记日	11.37	-0.87	0.31	
29	600500.SH	中化国际	2018/6/26	是	0.10	股权登记日	6.65	0.91	1.50	
30	600537.SH	亿晶光电	2018/6/26	是	0.01	股权登记日	3.14	0.00	0.41	
31	600551.SH	时代出版	2018/6/26	是	0.18	股权登记日	8.88	0.91	2.02	
32	601117.SH	中国化学	2018/6/26	是	0.10	股权登记日	7.28	-2.28	1.30	
33	603188.SH	亚邦股份	2018/6/26	是	0.05	股权登记日	9.34	3.09	0.54	
34	000725.SZ	京东方 A	2018/6/25	是	0.05	股权登记日	3.60	0.84	1.39	
35	000828.SZ	东莞控股	2018/6/25	是	0.25	股权登记日	8.17	2.77	3.06	
36	600236.SH	桂冠电力	2018/6/25	是	0.33	股权登记日	6.12	-0.65	5.39	
37	600580.SH	卧龙电气	2018/6/25	是	0.10	股权登记日	7.48	1.91	1.34	
38	601369.SH	陕鼓动力	2018/6/25	是	0.16	股权登记日	6.38	1.75	2.43	
39	601699.SH	潞安环能	2018/6/25	是	0.29	股权登记日	10.04	2.55	2.86	
40	603993.SH	洛阳钼业	2018/6/25	是	0.08	股权登记日	6.24	1.46	1.22	
41	000061.SZ	农产品	2018/6/22	是	0.05	股权登记日	5.56	-4.14	0.90	
42	000700.SZ	模塑科技	2018/6/22	是	0.12	股权登记日	3.63	0.00	3.31	
43	002129.SZ	中环股份	2018/6/22	是	0.02	股权登记日	7.26	2.25	0.28	
44	002151.SZ	北斗星通	2018/6/22	是	0.07	股权登记日	24.98	2.00	0.28	
45	600068.SH	葛洲坝	2018/6/22	是	0.27	股权登记日	7.69	7.10	3.49	
46	600109.SH	国金证券	2018/6/22	是	0.05	股权登记日	7.03	0.57	0.71	
47	600122.SH	宏图高科	2018/6/22	是	0.06	股权登记日	7.45	0.00	0.74	

48	600135.SH	乐凯胶片	2018/6/22	是	0.05	股权登记日	7.05	-0.28	0.68	
49	600201.SH	生物股份	2018/6/22	是	0.30	股权登记日	22.07	0.64	1.36	0.30
50	600210.SH	紫江企业	2018/6/22	是	0.15	股权登记日	3.51	0.29	4.27	
51	600330.SH	天通股份	2018/6/22	是	0.05	股权登记日	7.76	3.60	0.64	0.20
52	600998.SH	九州通	2018/6/22	是	0.10	股权登记日	17.06	1.19	0.59	
53	000027.SZ	深圳能源	2018/6/21	是	0.08	股权登记日	4.95	0.81	1.62	
54	000417.SZ	合肥百货	2018/6/21	是	0.15	股权登记日	6.05	0.83	2.48	
55	000513.SZ	丽珠集团	2018/6/21	是	2.00	股权登记日	64.18	2.30	3.12	0.30
56	000565.SZ	渝三峡A	2018/6/21	是	0.02	股权登记日	5.02	1.83	0.40	
57	000623.SZ	吉林敖东	2018/6/21	是	0.30	股权登记日	17.28	1.77	1.74	
58	000650.SZ	仁和药业	2018/6/21	是	0.10	股权登记日	5.90	4.24	1.69	
59	000937.SZ	冀中能源	2018/6/21	是	0.10	股权登记日	4.21	1.45	2.38	
60	001696.SZ	宗申动力	2018/6/21	是	0.03	股权登记日	4.92	2.93	0.61	
61	002078.SZ	太阳纸业	2018/6/21	是	0.10	股权登记日	9.87	0.51	1.01	
62	002304.SZ	洋河股份	2018/6/21	是	2.55	股权登记日	146.02	5.66	1.75	
63	002673.SZ	西部证券	2018/6/21	是	0.07	股权登记日	7.10	2.45	0.99	
64	300003.SZ	乐普医疗	2018/6/21	是	0.13	股权登记日	34.79	2.87	0.37	
65	600061.SH	国投资本	2018/6/21	是	0.06	股权登记日	9.31	0.76	0.67	
66	600073.SH	上海梅林	2018/6/21	是	0.03	股权登记日	6.94	-0.29	0.43	
67	600125.SH	铁龙物流	2018/6/21	是	0.08	股权登记日	8.60	1.18	0.93	
68	600161.SH	天坛生物	2018/6/21	是	0.20	股权登记日	25.92	1.77	0.77	0.30
69	600199.SH	金种子酒	2018/6/21	是	0.01	股权登记日	6.61	7.65	0.15	
70	600218.SH	全柴动力	2018/6/21	是	0.05	股权登记日	5.02	0.60	1.00	
71	600292.SH	远达环保	2018/6/21	是	0.06	股权登记日	5.78	0.52	0.95	
72	600470.SH	六国化工	2018/6/21	是	0.05	股权登记日	3.61	2.27	1.39	
73	600481.SH	双良节能	2018/6/21	是	0.05	股权登记日	3.10	0.65	1.61	
74	600616.SH	金枫酒业	2018/6/21	是	0.05	股权登记日	6.71	2.29	0.75	
75	600694.SH	大商股份	2018/6/21	是	0.90	股权登记日	34.11	1.28	2.64	
76	600773.SH	西藏城投	2018/6/21	是	0.01	股权登记日	7.04	-2.22	0.14	
77	600900.SH	长江电力	2018/6/21	是	0.68	股权登记日	17.56	-0.73	3.87	
78	601107.SH	四川成渝	2018/6/21	是	0.10	股权登记日	3.58	1.99	2.79	
79	601139.SH	深圳燃气	2018/6/21	是	0.15	股权登记日	7.29	2.53	2.06	0.30
80	601888.SH	中国国旅	2018/6/21	是	0.52	股权登记日	65.45	0.11	0.79	
81	601928.SH	凤凰传媒	2018/6/21	是	0.15	股权登记日	5.96	2.05	2.52	
82	000825.SZ	太钢不锈	2018/6/21	是		股东大会通过	6.00	0.00		
83	002594.SZ	比亚迪	2018/6/21	是		股东大会通过	45.39	0.91		
84	600288.SH	大恒科技	2018/6/21	是		股东大会通过	6.86	2.39		
85	600873.SH	梅花生物	2018/6/21	是		股东大会通过	4.24	1.68		
86	600881.SH	亚泰集团	2018/6/21	是		股东大会通过	3.79	-0.52		
87	601717.SH	郑煤机	2018/6/21	是		股东大会通过	5.67	3.09		
88	601800.SH	中国交建	2018/6/21	是		股东大会通过	12.06	0.75		
89	000690.SZ	宝新能源	2018/6/21	是	0.03	除权除息日	7.08	0.28	0.42	
90	000823.SZ	超声电子	2018/6/21	是	0.08	除权除息日	6.60	0.46	1.21	
91	000988.SZ	华工科技	2018/6/21	是	0.03	除权除息日	14.27	2.66	0.21	
92	000999.SZ	华润三九	2018/6/21	是	0.46	除权除息日	28.37	2.79	1.62	
93	002261.SZ	拓维信息	2018/6/21	是	0.01	除权除息日	4.41	-0.68	0.23	

94	002368.SZ	太极股份	2018/6/21	是	0.21	除权除息日	24.96	1.13	0.85	
95	300147.SZ	香雪制药	2018/6/21	是	0.03	除权除息日	7.21	0.42	0.42	
96	300212.SZ	易华录	2018/6/21	是	0.15	除权除息日	27.30	1.68	0.55	0.20
97	300273.SZ	和佳股份	2018/6/21	是	0.03	除权除息日	6.55	3.15	0.46	
98	600376.SH	首开股份	2018/6/21	是	0.60	除权除息日	8.62	2.50	6.96	
99	600502.SH	安徽水利	2018/6/21	是	0.05	除权除息日	4.95	0.20	1.01	0.20
100	600611.SH	大众交通	2018/6/21	是	0.12	除权除息日	4.06	2.01	2.96	

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 个交易日共有亚泰集团、金证股份、凯乐科技等 9 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	600881.SH	亚泰集团	2018/6/22	62343.59	23.98	定向增发机构配售股份	3.79	-0.52
2	600446.SH	金证股份	2018/6/25	3360.00	4.19	定向增发机构配售股份	11.16	0.90
3	600260.SH	凯乐科技	2018/6/25	2526.05	4.19	定向增发机构配售股份	27.03	1.85
4	601211.SH	国泰君安	2018/6/26	278341.63	58.81	首发原股东限售股份	15.19	-0.46
5	000333.SZ	美的集团	2018/6/26	8250.00	1.29	定向增发机构配售股份	55.16	0.99
6	002203.SZ	海亮股份	2018/6/29	12336.45	8.35	定向增发机构配售股份	8.18	-0.24
7	002016.SZ	世荣兆业	2018/7/2	16300.00	25.23	定向增发机构配售股份	14.64	0.41
8	600816.SH	安信信托	2018/7/2	167538.46	55.90	定向增发机构配售股份	7.25	2.26
9	600606.SH	绿地控股	2018/7/2	894478.61	277.50	定向增发机构配售股份	6.92	0.58

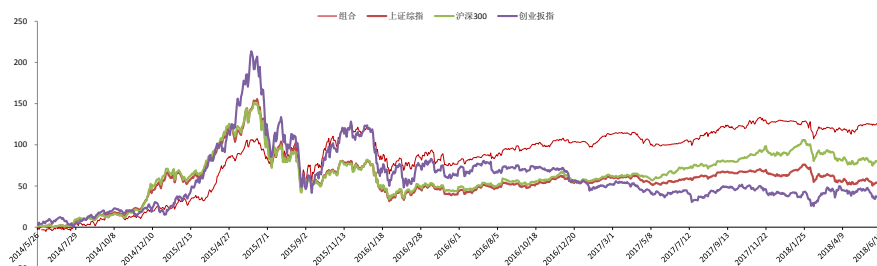
数据来源: Wind、信达证券研发中心

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 0.48%, 至 2018 年 6 月 20 日组合累计收益率为 118.92%, 分别超越上证综指、沪深 300 及创业板指 74.67、48.31 及 95.74 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	-2.42	-2.57	-0.38	-4.65	8.83	7.73
上证综指	-4.49	-7.56	-11.41	-10.73	-7.27	-6.05
沪深 300	-3.82	-5.92	-11.25	-8.68	2.30	9.83
创业板指	-7.39	-14.60	-15.41	-12.34	-13.91	-20.30

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 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					

数据来源：Wind、信达证券研发中心

2) 今日拟平仓股票

今日拟平仓股票有泛海控股等 1 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	000046.SZ	泛海控股	2018/5/22	3.00	-12.34

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

昨日平仓股票有普洛药业、上海银行等 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	000739.SZ	普洛药业	2018/05/21	7.42	3.00	6.94	-6.41
2	601229.SH	上海银行	2018/05/21	15.98	3.00	15.65	-2.06

数据来源：Wind、信达证券研发中心

4. 组合成分股

至 2018 年 6 月 20 日收盘，组合共有成分股 8 只，仓位 24%。

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	000046.SZ	泛海控股	2018/5/22	7.11	3.00	6.23	-12.34	-3.06
2	600661.SH	新南洋	2018/5/25	30.37	3.00	24.79	-18.36	-10.79
3	600395.SH	盘江股份	2018/5/28	6.27	3.00	6.14	-2.03	5.15
4	002154.SZ	报喜鸟	2018/5/29	3.38	3.00	3.17	-6.35	0.65
5	000690.SZ	宝新能源	2018/6/1	8.08	3.00	7.08	-12.37	-6.56
6	000739.SZ	普洛药业	2018/6/5	7.26	3.00	7.00	-3.58	2.09
7	600418.SH	江淮汽车	2018/6/7	7.35	3.00	6.52	-11.31	-4.90
8	000860.SZ	顺鑫农业	2018/6/14	40.98	3.00	41.66	1.66	6.06

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