

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7月26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 8932.79 亿元(+0.13%), 其中融资余额规模为 8857.03 亿元(+0.12%), 融券余额规模为 75.76 亿元(+1.11%)。从融资规模来看, 上一交易日沪深两市融资买入额为 315.98 亿元(-25.58%), 融资偿还额为 305.03 亿元(-28.47%)。
- 上一交易日, 市场指数中创业板指(+0.17%)表现最好, 上证综指(-0.07%)表现最弱; 从行业来看, 休闲服务(+2.75%)、钢铁(+1.87%)、传媒(+1.08%)、医药生物(+1.06%)、汽车(+0.52%)等行业表现较好, 家用电器(-1.08%)、有色金属(-0.63%)、公用事业(-0.58%)、纺织服装(-0.58%)、通信(-0.53%)等行业表现较弱。
- 两融标的股票中, 涨幅前五名为: 山推股份(+10.11%)、蓝色光标(+10.09%)、青青稞酒(+10%)、普洛药业(+10%) 和华兰生物(+9.99%); 跌幅前五名为: 海航投资(-9.94%)、亚厦股份(-5.72%)、泛海控股(-5.19%)、美尔雅(-4.05%) 和嘉化能源(-4.03%); 五日量比前五名为: 四川路桥(8.48)、青青稞酒(6.68)、普洛药业(5.77)、浦东建设(5.36) 和西藏天路(5.12)。
- 上一交易日, 发生大宗交易的标的股票有盛屯矿业、中国铝业、广誉远等 9 只。
- 今日披露, 大股东增持标的股票有 TCL 集团、亚厦股份、北方稀土等 2 只, 大股东减持标的股票有海信科龙等 4 只。
- 今日披露, 共有 1 只标的股票涉及增发事件, 其中没有股票涉及董事会预案, 没有股票涉及股东大会通过, 安凯客车等 1 只为增发公告日, 没有股票涉及增发股份上市日。
- 今日披露, 共有 31 只标的股票涉及分红送转事件, 其中有泰山石油、湖北能源、中通客车等 4 只为实施公告日, 中国宝安、富奥股份、潍柴动力等 16 只为股权登记日, 富奥股份、潍柴动力、鄂武商 A 等 11 只为除权除息日。
- 今日共有江铃汽车、兴蓉环境、思源电气等 7 只标的股票发布业绩快报, 际华集团等 1 只标的股票发布业绩预告。
- 未来 7 个交易日共有爱建集团、广誉远、亨通光电等 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。
- 今日无拟平仓股票。
- 上一交易日组合收益率为 0.24%, 至 2018 年 7 月 25 日组合累计收益率为 129.69%, 分别超越上证综指、沪深 300 及创业板指 86.03、61.79 及 101.11 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. 大股东增减持标的股票	10
2. 标的股票增发	10
3. 标的股票分红送转	10
4. 发布相关业绩报告的标的股票	11
5. 标的股票限售股解禁	12
三、事件投资组合操作	12
1. 组合历史收益	12
2. 今日组合操作	13
3. 昨日组合操作回顾	13
4. 组合成分股	13

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: 大股东持股比例变动标的股票	10
图表 14: 未来七个交易日标的股票增发	10
图表 15: 未来七个交易日发生分红送转事件标的股票	10
图表 16: 今日发布相关业绩报告的标的股票	11
图表 17: 未来七个交易日标的股票限售解禁	12
图表 18: 组合历史收益曲线	12
图表 19: 组合历史收益对比	12
图表 20: 今日拟建仓股票	13
图表 21: 今日拟平仓股票	13
图表 22: 昨日建仓股票	13
图表 23: 昨日平仓股票	13

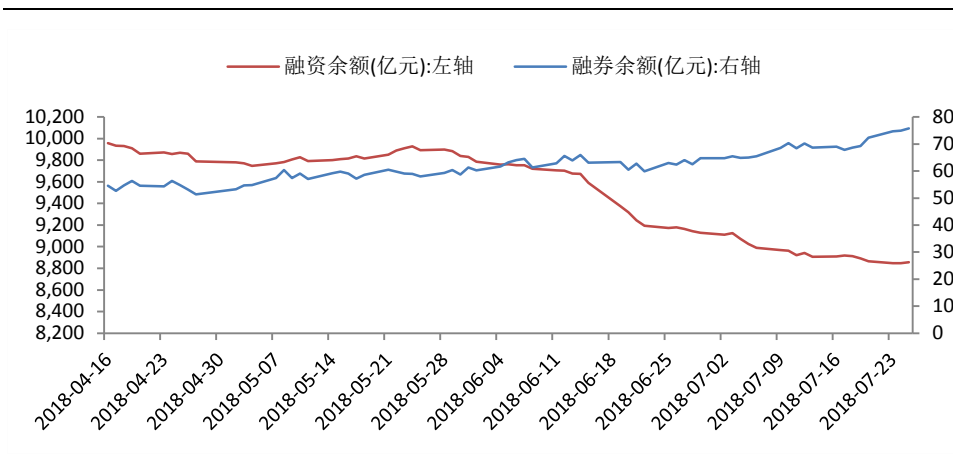
图表 24: 组合成分股.....	13
-------------------	----

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 8932.79 亿元(+0.13%)，其中融资余额规模为 8857.03 亿元(+0.12%)，融券余额规模为 75.76 亿元(+1.11%)。

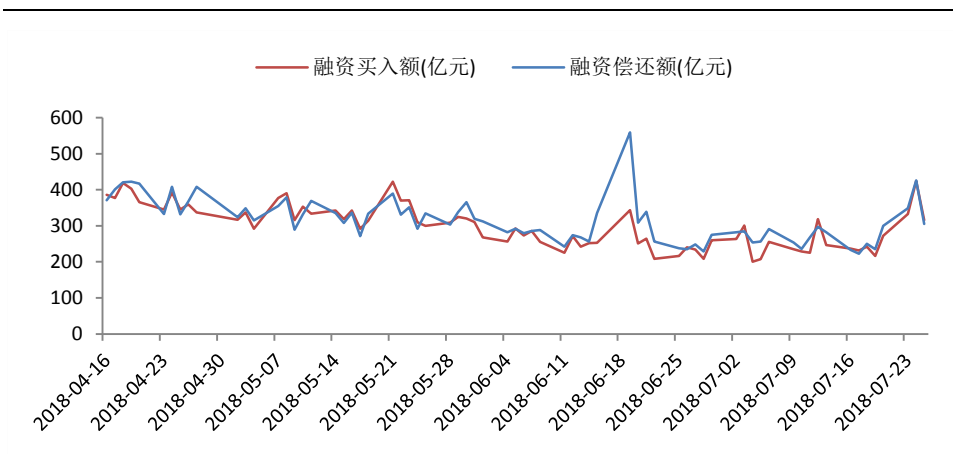
图表 1：近三月每日融资融券余额规模（亿元）



数据来源：Wind、信达证券研发中心

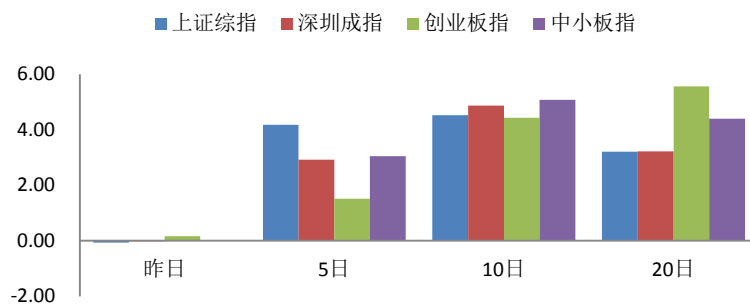
从融资规模来看，上一交易日沪深两市融资买入额为 315.98 亿元(-25.58%)，融资偿还额为 305.03 亿元(-28.47%)。

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 0.17%，上证综指表现最弱，下跌 0.07%；从 5 日涨跌幅看，上证综指表现较好，上涨 4.18%，创业板指表现最弱，上涨 1.52%；从 10 日涨跌幅看，中小板指表现较好，上涨 5.07%，创业板指表现最弱，上涨 4.43%；从 20 日涨跌幅看，创业板指表现较好，上涨 5.57%，上证综指表现最弱，上涨 3.22%。

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，建筑装饰(+2.28%)、家用电器(+1.78%)、电气设备(+0.95%)等行业增速居前，传媒(-0.62%)、医药生物(-1.03%)、休闲服务(-5.93%)等行业增速靠后。

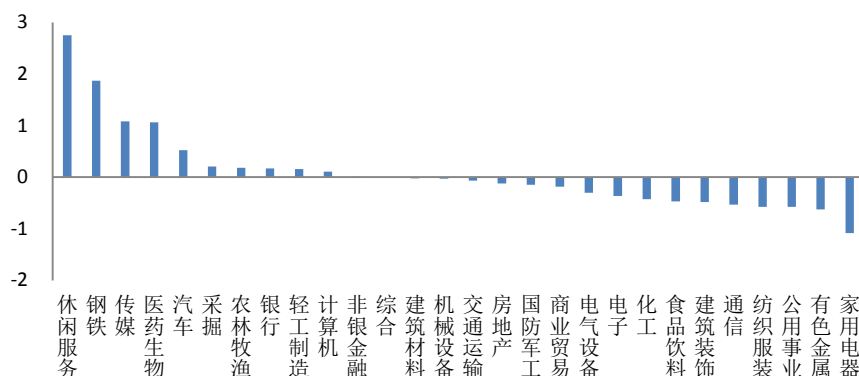
图表 4：上一交易日两融标的股票分行业融资余额占流通市值比例及增速（%）

序号	代码	行业	融资余额占流通市值比例(%)	占比增速(%)
1	801720.SI	建筑装饰	2.30	2.28
2	801110.SI	家用电器	2.00	1.78
3	801730.SI	电气设备	4.16	0.95
4	801130.SI	纺织服装	2.67	0.95
5	801170.SI	交通运输	1.90	0.90
6	801050.SI	有色金属	5.58	0.81
7	801080.SI	电子	4.31	0.75
8	801160.SI	公用事业	2.50	0.72
9	801010.SI	农林牧渔	2.91	0.63
10	801200.SI	商业贸易	4.58	0.43
11	801180.SI	房地产	3.60	0.41
12	801770.SI	通信	6.37	0.39
13	801120.SI	食品饮料	1.04	0.34
14	801030.SI	化工	2.76	0.24
15	801790.SI	非银金融	2.57	0.21
16	801140.SI	轻工制造	6.05	0.18
17	801020.SI	采掘	0.90	0.05
18	801890.SI	机械设备	3.70	-0.03
19	801740.SI	国防军工	4.17	-0.05
20	801230.SI	综合	7.70	-0.16
21	801780.SI	银行	1.02	-0.25
22	801040.SI	钢铁	2.35	-0.28
23	801710.SI	建筑材料	2.80	-0.36
24	801750.SI	计算机	6.80	-0.43
25	801880.SI	汽车	2.22	-0.47
26	801760.SI	传媒	5.26	-0.62
27	801150.SI	医药生物	2.74	-1.03
28	801210.SI	休闲服务	1.86	-5.93

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,休闲服务(+2.75%)、钢铁(+1.87%)、传媒(+1.08%)、医药生物(+1.06%)、汽车(+0.52%)等行业表现较好,家用电器(-1.08%)、有色金属(-0.63%)、公用事业(-0.58%)、纺织服装(-0.58%)、通信(-0.53%)等行业表现较弱。

图表 5: 申万行业上一交易日涨跌幅(%)

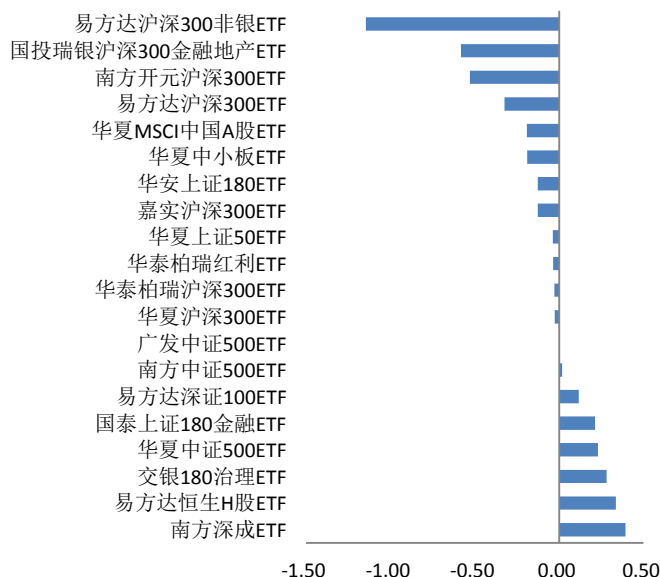


数据来源: Wind、信达证券研发中心

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:南方深成 ETF(+0.39%)、易方达恒生 H 股 ETF(+0.34%)及交银 180 治理 ETF(+0.28%);跌幅前三名为:易方达沪深 300 非银 ETF(-1.14%)、国投瑞银沪深 300 金融地产 ETF(-0.58%)及南方开元沪深 300ETF(-0.53%)。

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:山推股份(+10.11%)、蓝色光标(+10.09%)、青青稞酒(+10%)、普洛药业(+10%)和华兰生物(+9.99%);跌幅前五名为:海航投资(-9.94%)、亚厦股份(-5.72%)、泛海控股(-5.19%)、美尔雅(-4.05%)

和嘉化能源 (-4.03%)。

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	000680.SZ	山推股份	10.11	3.77	000616.SZ	海航投资	-9.94	0.00
2	300058.SZ	蓝色光标	10.09	0.54	002375.SZ	亚厦股份	-5.72	1.06
3	002646.SZ	青青稞酒	10.00	6.68	000046.SZ	泛海控股	-5.19	0.92
4	000739.SZ	普洛药业	10.00	5.77	600107.SH	美尔雅	-4.05	1.61
5	002007.SZ	华兰生物	9.99	1.34	600273.SH	嘉化能源	-4.03	0.80
6	000506.SZ	中润资源	9.93	2.44	600221.SH	海航控股	-3.85	3.03
7	300202.SZ	聚龙股份	8.61	2.11	002466.SZ	天齐锂业	-3.54	1.72
8	000563.SZ	陕国投 A	7.14	0.00	600310.SH	桂东电力	-3.43	1.71
9	000938.SZ	紫光股份	7.04	2.26	000801.SZ	四川九洲	-3.41	1.53
10	000650.SZ	仁和药业	6.52	0.97	601186.SH	中国铁建	-3.14	1.32
11	600285.SH	羚锐制药	5.90	1.54	600525.SH	长园集团	-3.13	1.45
12	000661.SZ	长春高新	5.80	1.67	002271.SZ	东方雨虹	-3.12	0.95
13	000528.SZ	柳工	5.80	1.59	300033.SZ	同花顺	-2.90	1.50
14	600609.SH	金杯汽车	5.56	2.93	601377.SH	兴业证券	-2.84	1.99
15	601888.SH	中国国旅	5.52	1.11	002460.SZ	赣锋锂业	-2.79	1.31
16	000717.SZ	韶钢松山	5.36	2.23	600711.SH	盛屯矿业	-2.78	0.86
17	600326.SH	西藏天路	5.28	5.12	600739.SH	辽宁成大	-2.73	1.29
18	000932.SZ	华菱钢铁	5.16	1.26	300274.SZ	阳光电源	-2.65	1.17
19	600460.SH	士兰微	4.68	2.92	600502.SH	安徽水利	-2.43	1.54
20	600186.SH	莲花健康	4.59	3.65	601012.SH	隆基股份	-2.43	1.04

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：四川路桥（8.48）、青青稞酒（6.68）、普洛药业（5.77）、浦东建设（5.36）和西藏天路（5.12）。

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	600039.SH	四川路桥	3.67	8.48
2	002646.SZ	青青稞酒	10.00	6.68
3	000739.SZ	普洛药业	10.00	5.77
4	600284.SH	浦东建设	-0.18	5.36
5	600326.SH	西藏天路	5.28	5.12
6	603169.SH	兰石重装	3.17	3.79
7	000680.SZ	山推股份	10.11	3.77
8	600186.SH	莲花健康	4.59	3.65
9	600699.SH	均胜电子	3.82	3.56
10	300355.SZ	蒙草生态	2.60	3.48
11	601800.SH	中国交建	-0.37	3.44
12	600620.SH	天宸股份	3.86	3.41
13	600491.SH	龙元建设	-1.90	3.03
14	600221.SH	海航控股	-3.85	3.03

15	600331.SH	宏达股份	4.00	2.98
16	002307.SZ	北新路桥	-0.16	2.93
17	600609.SH	金杯汽车	5.56	2.93
18	600460.SH	士兰微	4.68	2.92
19	000554.SZ	泰山石油	2.22	2.86
20	600653.SH	申华控股	1.55	2.82

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: 海航投资(314.52%)、金科股份(49.9%)、皖能电力(42.5%)、同方股份(39.48%)、羚锐制药(38.92%)。

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	000616.SZ	海航投资	-9.94	314.52	71.75
2	000656.SZ	金科股份	0.80	49.90	65.99
3	000543.SZ	皖能电力	0.20	42.50	14.96
4	600100.SH	同方股份	1.42	39.48	43.08
5	600285.SH	羚锐制药	5.90	38.92	43.65
6	000513.SZ	丽珠集团	1.97	35.92	90.91
7	600270.SH	外运发展	1.45	31.39	32.73
8	000539.SZ	粤电力 A	0.00	28.69	1.76
9	600653.SH	申华控股	1.55	28.36	8.24
10	601877.SH	正泰电器	-0.04	28.33	36.44
11	600282.SH	南钢股份	3.03	27.67	153.26
12	600166.SH	福田汽车	1.52	27.62	30.43
13	000767.SZ	漳泽电力	1.09	27.59	2.05
14	600699.SH	均胜电子	3.82	27.34	57.19
15	600582.SH	天地科技	2.54	27.23	16.34
16	000963.SZ	华东医药	4.27	27.13	140.06
17	600777.SH	新潮能源	3.83	26.58	28.67
18	600483.SH	福能股份	3.01	26.02	6.78
19	600998.SH	九州通	2.71	25.73	19.04
20	600620.SH	天宸股份	3.86	25.34	7.66

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: 同方股份(29.27%)、新潮能源(19.66%)、永辉超市(18.17%)、重庆啤酒(17.26%)、锦富技术(15.36%); 尾盘金额流入率最高的前五名是: 海航投资(77.27%)、北京银行(22.64%)、兴民智通(22.18%)、数码科技(18.82%)、新潮能源(17.32%)。

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	600100.SH	同方股份	1.42	29.27	31.95	000616.SZ	海航投资	-9.94	77.27	55.44
2	600777.SH	新潮能源	3.83	19.66	21.21	601169.SH	北京银行	-0.17	22.64	40.86
3	601933.SH	永辉超市	1.28	18.17	94.28	002355.SZ	兴民智通	0.00	22.18	4.97
4	600132.SH	重庆啤酒	-0.81	17.26	11.40	300079.SZ	数码科技	2.44	18.82	18.02
5	300128.SZ	锦富技术	1.15	15.36	21.26	600777.SH	新潮能源	3.83	17.32	18.68
6	600416.SH	湘电股份	0.14	14.87	5.32	000767.SZ	漳泽电力	1.09	15.78	1.18

7	600009.SH	上海机场	2.07	14.51	76.74	600998.SH	九州通	2.71	14.32	10.61
8	600572.SH	康恩贝	2.17	12.87	18.61	600823.SH	世茂股份	0.72	13.60	6.27
9	600716.SH	凤凰股份	0.27	12.85	1.53	600851.SH	海欣股份	1.30	12.94	1.87
10	000062.SZ	深圳华强	-0.57	12.64	9.09	600186.SH	莲花健康	4.59	12.35	6.02
11	002065.SZ	东华软件	1.04	12.55	55.55	600582.SH	天地科技	2.54	11.71	7.03
12	002195.SZ	二三四五	1.77	11.86	110.09	600229.SH	城市传媒	0.00	11.67	1.37
13	300034.SZ	钢研高纳	0.69	11.85	5.54	002130.SZ	沃尔核材	0.71	10.74	3.07
14	600337.SH	美克家居	0.38	11.55	4.89	000905.SZ	厦门港务	0.63	10.73	3.37
15	601288.SH	农业银行	0.55	11.51	87.03	002022.SZ	科华生物	1.56	10.18	4.77
16	002276.SZ	万马股份	0.17	11.20	6.96	000404.SZ	华意压缩	1.13	9.99	1.65
17	600085.SH	同仁堂	0.69	11.13	23.91	000631.SZ	顺发恒业	0.29	9.59	2.03
18	002474.SZ	榕基软件	2.81	11.12	20.31	600523.SH	贵航股份	-0.23	9.39	1.30
19	600741.SH	华域汽车	0.56	10.99	18.86	002287.SZ	奇正藏药	1.24	9.19	2.12
20	002152.SZ	广电运通	-0.17	10.62	9.25	603188.SH	亚邦股份	3.68	8.73	13.05

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(25.6%)、恒泰艾普(20.39%)、数码科技(20.35%)等,融资余额占流通市值比例增速前十名通威股份(+41.69%)、二三四五(+18.13%)、天齐锂业(+15.56%)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	25.60	600438.SH	通威股份	41.69
2	300157.SZ	恒泰艾普	20.39	002195.SZ	二三四五	18.13
3	300079.SZ	数码科技	20.35	002466.SZ	天齐锂业	15.56
4	000551.SZ	创元科技	20.21	600782.SH	新钢股份	13.67
5	300273.SZ	和佳股份	18.56	000860.SZ	顺鑫农业	12.42
6	300355.SZ	蒙草生态	18.39	600221.SH	海航控股	11.99
7	600692.SH	亚通股份	18.34	603369.SH	今世缘	11.37
8	600470.SH	六国化工	17.96	002375.SZ	亚厦股份	10.06
9	300005.SZ	探路者	17.88	600901.SH	江苏租赁	9.49
10	000917.SZ	电广传媒	17.65	601186.SH	中国铁建	9.42

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盛屯矿业、中国铝业、广誉远等 9 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	600711.SH	盛屯矿业	9.50	9.71	-2.16	9.44	2086.65	19823.15
2	601600.SH	中国铝业	3.88	3.95	-1.77	3.88	60.00	232.80
3	600771.SH	广誉远	44.60	49.55	-9.99	48.82	11.48	512.01
4	600104.SH	上汽集团	32.74	32.57	0.52	32.74	174.00	5696.76
5	000656.SZ	金科股份	4.50	4.99	-9.82	5.03	1500.00	6750.00
6	000413.SZ	东旭光电	5.96	6.28	-5.10	6.24	1930.00	11502.80

7	002466.SZ	天齐锂业	49.04	50.84	-3.54	49.04	4.37	214.30
8	300015.SZ	爱尔眼科	34.26	33.20	3.19	34.26	6.00	205.56
9	002467.SZ	二六三	5.28	5.87	-10.05	5.75	300.00	1584.00

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. 大股东增减持标的股票

今日披露, 大股东增持标的股票有 TCL 集团、亚厦股份、北方稀土等 2 只, 大股东减持标的股票有海信科龙等 4 只。

图表 13: 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	000100.SZ	TCL 集团	2018/7/26	2018/7/25	增持	0.8454	0.00	0.73	2.82	2.86	
2	000921.SZ	海信科龙	2018/7/26	2018/7/25	减持	0.01	0.00	0.03	9.20	9.26	-0.32
3	002375.SZ	亚厦股份	2018/7/26	2018/7/24	增持	0.16	0.00	0.90	6.53	6.49	-5.72
4	002467.SZ	二六三	2018/7/26	2018/7/25	减持	0.4769	100	17.386	5.28	5.77251	
5	002681.SZ	奋达科技	2018/7/26	2018/7/17	减持	0.05	0.00	0.16	5.60	5.58	-0.53
6	002681.SZ	奋达科技	2018/7/26	2018/7/16	减持	0.012	0	0.1789	5.75	5.71443	
7	300015.SZ	爱尔眼科	2018/7/26	2018/7/24	减持	0.24	0.00	3.56	33.37	33.28	3.19
8	600111.SH	北方稀土	2018/7/26	2018/7/23	增持	0.00	0.00	0.00	10.70		-1.23
9	600111.SH	北方稀土	2018/7/26	2018/7/23	增持	0.00	0.00	0.00	10.89		-1.23

数据来源: Wind、信达证券研发中心

2. 标的股票增发

今日披露, 共有 1 只标的股票涉及增发事件, 其中没有股票涉及董事会预案, 没有股票涉及股东大会通过, 安凯客车等 1 只为增发公告日, 没有股票涉及增发股份上市日。

图表 14: 未来七个交易日标的股票增发

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	000868.SZ	安凯客车	2018-07-26	增发公告日	5.16	定向	5.57	4.50

数据来源: Wind、信达证券研发中心

3. 标的股票分红送转

今日披露, 共有 31 只标的股票涉及分红送转事件, 其中有泰山石油、湖北能源、中通客车等 4 只为实施公告日, 中国宝安、富奥股份、潍柴动力等 16 只为股权登记日, 富奥股份、潍柴动力、鄂武商 A 等 11 只为除权除息日。

图表 15: 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	000009.SZ	中国宝安	2018/7/26	是	0.02	股权登记日	5.12	-0.78	0.39	
2	000030.SZ	富奥股份	2018/7/26	是	0.20	除权除息日	7.55	-1.44	2.65	0.40
3	000338.SZ	潍柴动力	2018/7/30	是	0.25	股权登记日	8.88	0.68	2.82	

4	000501.SZ	鄂武商 A	2018/7/26	是	0.08	股权登记日	11.85	0.00	0.68	
5	000554.SZ	泰山石油	2018/7/26	是	0.01	实施公告日	5.99	2.22	0.17	
6	000883.SZ	湖北能源	2018/7/26	是	0.10	股权登记日	4.34	-0.23	2.30	
7	000957.SZ	中通客车	2018/7/30	是	0.20	股权登记日	6.96	2.35	2.87	
8	000997.SZ	新大陆	2018/7/26	是	0.08	除权除息日	16.09	-0.86	0.50	
9	002063.SZ	远光软件	2018/7/26	是	0.05	除权除息日	9.00	-0.44	0.56	0.40
10	002250.SZ	联化科技	2018/7/26	是	0.10	除权除息日	8.30	1.34	1.20	
11	002405.SZ	四维图新	2018/7/26	是	0.04	股权登记日	20.34	-0.54	0.21	
12	300182.SZ	捷成股份	2018/7/26	是	0.04	股权登记日	7.12	0.71	0.59	
13	600027.SH	华电国际	2018/7/26	是	0.02	股权登记日	4.36	-0.91	0.41	
14	600066.SH	宇通客车	2018/7/26	是	0.50	股权登记日	18.17	2.14	2.75	
15	600166.SH	福田汽车	2018/7/26	是	0.01	除权除息日	2.00	1.52	0.26	
16	600260.SH	凯乐科技	2018/7/26	是	0.10	除权除息日	27.15	-1.91	0.37	
17	600269.SH	赣粤高速	2018/7/26	是	0.17	实施公告日	4.30	-0.46	3.95	
18	600315.SH	上海家化	2018/7/26	是	0.18	除权除息日	40.39	0.22	0.45	
19	600482.SH	中国动力	2018/7/26	是	0.21	除权除息日	18.69	0.65	1.11	
20	600600.SH	青岛啤酒	2018/7/26	是	0.42	实施公告日	46.02	-1.03	0.91	
21	600684.SH	珠江实业	2018/7/26	是	0.05	除权除息日	4.90	0.41	1.02	
22	600705.SH	中航资本	2018/7/26	是	0.06	除权除息日	4.83	-1.23	1.14	
23	600826.SH	兰生股份	2018/7/30	是	0.21	股权登记日	15.20	0.40	1.38	
24	600837.SH	海通证券	2018/7/31	是	0.23	股权登记日	9.72	-0.82	2.37	
25	600851.SH	海欣股份	2018/7/26	是	0.03	除权除息日	8.60	1.30	0.35	
26	600863.SH	内蒙华电	2018/7/27	是	0.03	股权登记日	2.38	0.00	1.26	
27	600873.SH	梅花生物	2018/7/27	是	0.33	股权登记日	4.56	0.88	7.24	
28	601216.SH	君正集团	2018/7/26	是	0.03	股权登记日	3.41	-1.16	0.88	
29	601818.SH	光大银行	2018/7/26	是	0.18	股权登记日	3.84	0.26	4.71	
30	601901.SH	方正证券	2018/7/26	是	0.01	实施公告日	6.86	-0.29	0.15	
31	603000.SH	人民网	2018/7/27	是	0.05	股权登记日	8.37	0.12	0.54	

数据来源: Wind、信达证券研发中心

4. 发布相关业绩报告的标的股票

今日共有江铃汽车、兴蓉环境、思源电气等 7 只标的股票发布业绩快报, 际华集团等 1 只标的股票发布业绩预告。

图表 16: 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	000550.SZ	江铃汽车	半年度快报		-43.71	12.13	0.92
2	000598.SZ	兴蓉环境	半年度快报		18.44	4.28	-0.23
3	002028.SZ	思源电气	半年度快报		-15.54	16.45	-0.30
4	002142.SZ	宁波银行	半年度快报		3.10	16.90	0.36
5	002262.SZ	恩华药业	半年度快报		28.30	18.35	4.38
6	002287.SZ	奇正藏药	半年度快报		14.88	29.35	1.24
7	600410.SH	华胜天成	半年度快报		-79.36	9.08	0.44
8	601718.SH	际华集团	半年度预告	预减	-68.53	4.19	-0.48

数据来源: Wind、信达证券研发中心

5. 标的股票限售股解禁

未来7个交易日共有爱建集团、广誉远、亨通光电等9只标的股票涉及限售股解禁。

图表 17: 未来七个交易日标的股票限售解禁

序号	股票代码	股票简称	解禁时间	解禁数量(万股)	占解禁前A股流通股比	流通股份类型	前收盘价	前涨跌幅(%)
1	600643.SH	爱建集团	2018/7/30	3.07	0.00	股权分置限售股份	9.27	0.11
2	600771.SH	广誉远	2018/7/30	3400.00	12.67	定向增发机构配售股份	48.82	-1.47
3	600487.SH	亨通光电	2018/7/30	12254.87	7.05	定向增发机构配售股份	23.37	-0.09
4	300182.SZ	捷成股份	2018/7/30	22386.75	16.10	定向增发机构配售股份	7.12	0.71
5	002151.SZ	北斗星通	2018/7/30	5201.57	20.42	定向增发机构配售股份	26.79	-0.70
6	002273.SZ	水晶光电	2018/8/6	1077.75	1.35	定向增发机构配售股份	13.17	-1.72
7	000623.SZ	吉林敖东	2018/8/6	2325.54	2.12	股权分置限售股份,追加承诺限售股份上市流通	17.66	-0.84
8	000623.SZ	吉林敖东	2018/8/6	2325.54	2.12	股权分置限售股份,追加承诺限售股份上市流通	17.66	-0.84
9	002273.SZ	水晶光电	2018/8/6	829.04	1.35	定向增发机构配售股份	13.17	-1.72

数据来源: Wind、信达证券研发中心

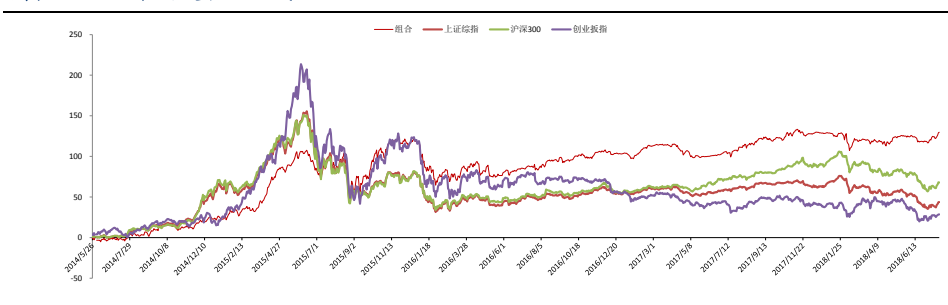
三、事件投资组合操作

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0.24%, 至2018年7月25日组合累计收益率为129.69%, 分别超越上证综指、沪深300及创业板指86.03、61.79及101.11个百分点。

图表 18: 组合历史收益曲线



数据来源: Wind、信达证券研发中心

图表 19: 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	3.45	5.16	5.52	0.54	10.62	13.02
上证综指	3.77	0.48	-5.36	-17.07	-10.67	-6.44
沪深300	3.72	-0.86	-5.01	-17.50	-4.43	8.09
创业板指	0.66	5.33	-6.89	-7.69	-3.21	-16.81

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 20：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					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

今日无拟平仓股票。

图表 21：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

昨日建仓股票有京能电力等 1 只。

图表 22：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	600578.SH	京能电力	3.40	3.00	业绩预增

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 23：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 7 月 25 日收盘，组合共有成分股 32 只，仓位 96.01%。

图表 24：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	000596.SZ	古井贡酒	2018/7/2	93.41	3.00	94.77	1.46	-0.52
2	300122.SZ	智飞生物	2018/7/2	47.31	3.00	42.42	-10.34	-12.31
3	002273.SZ	水晶光电	2018/7/3	12.39	3.00	13.17	6.32	1.71
4	601233.SH	桐昆股份	2018/7/3	16.30	3.00	18.88	15.81	11.19
5	000932.SZ	华菱钢铁	2018/7/4	8.63	3.00	9.98	15.58	11.39
6	600330.SH	天通股份	2018/7/5	6.86	3.00	7.28	6.08	0.84
7	600426.SH	华鲁恒升	2018/7/6	16.87	3.00	19.08	13.08	6.87
8	600673.SH	东阳光科	2018/7/6	9.36	3.00	8.92	-4.74	-10.95
9	000661.SZ	长春高新	2018/7/9	233.37	3.00	216.90	-7.06	-12.75
10	600143.SH	金发科技	2018/7/9	5.04	3.00	5.13	1.71	-3.99

11	000338.SZ	潍柴动力	2018/7/10	8.49	3.00	8.88	4.62	1.48
12	600596.SH	新安股份	2018/7/10	17.42	3.00	19.29	10.74	7.59
13	000812.SZ	陕西金叶	2018/7/11	3.77	3.00	3.69	-2.08	-4.77
14	600141.SH	兴发集团	2018/7/11	11.93	3.00	13.11	9.88	7.19
15	000717.SZ	韶钢松山	2018/7/12	6.67	3.00	7.67	14.99	10.45
16	600277.SH	亿利洁能	2018/7/12	5.23	3.00	5.48	4.69	0.16
17	000062.SZ	深圳华强	2018/7/13	20.40	3.00	20.98	2.82	0.50
18	300257.SZ	开山股份	2018/7/13	14.70	3.00	15.25	3.77	1.44
19	600458.SH	时代新材	2018/7/13	7.72	3.00	9.05	17.16	14.84
20	000425.SZ	徐工机械	2018/7/16	3.94	3.00	4.21	6.82	4.26
21	002353.SZ	杰瑞股份	2018/7/16	17.63	3.00	18.15	2.94	0.38
22	300059.SZ	东方财富	2018/7/16	12.97	3.00	13.90	7.17	4.61
23	600559.SH	老白干酒	2018/7/17	20.96	3.00	21.19	1.10	-2.09
24	600580.SH	卧龙电气	2018/7/17	7.84	3.00	8.01	2.22	-0.96
25	600711.SH	盛屯矿业	2018/7/18	9.65	3.00	9.44	-2.21	-5.98
26	600487.SH	亨通光电	2018/7/19	22.26	3.00	23.37	5.01	0.83
27	601336.SH	新华保险	2018/7/19	45.87	3.00	50.02	9.04	4.86
28	600282.SH	南钢股份	2018/7/20	4.63	3.00	5.10	10.21	5.49
29	600970.SH	中材国际	2018/7/20	6.48	3.00	7.03	8.51	3.78
30	600236.SH	桂冠电力	2018/7/23	5.85	3.00	5.79	-1.01	-3.64
31	601898.SH	中煤能源	2018/7/23	4.75	3.00	4.94	3.93	1.30
32	600578.SH	京能电力	2018/7/25	3.40	3.00	3.38	-0.54	-0.48

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 16 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	010-83252068	13671072405	yuanq@cindasc.com
华北	张 华	010-83252088	13691304086	zhanghuac@cindasc.com
华北	巩婷婷	010-83252069	13811821399	gongtingting@cindasc.com
华东	王莉本	021-61678580	18121125183	wangliben@cindasc.com
华东	文襄琳	021-61678586	13681810356	wenxianglin@cindasc.com
华东	洪 辰	021-61678568	13818525553	hongchen@cindasc.com
华南	袁 泉	010-83252068	13671072405	yuanq@cindasc.com
国际	唐 蕾	010-83252046	18610350427	tanglei@cindasc.com