

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

2019年5月17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 9379.35 亿元(+0%), 其中融资余额规模为 9299.45 亿元(-0.03%), 融券余额规模为 79.89 亿元(+3.49%)。从融资规模来看, 上一交易日沪深两市融资买入额为 419.8 亿元(-2.4%), 融资偿还额为 422.25 亿元(-1.45%)。
- 上一交易日, 市场指数中上证综指(+0.58%)表现最好, 中小板指(+0.23%)表现最弱; 从行业来看, 综合(+1.99%)、国防军工(+1.99%)、交通运输(+1.99%)、汽车(+1.99%)、商业贸易(+1.99%)等行业表现较好, 农林牧渔(+1.99%)、通信(+1.99%)、休闲服务(+1.99%)、家用电器(+1.99%)、非银金融(+1.99%)等行业表现较弱。
- 两融标的股票中, 涨幅前五名为: 中色股份(+10.11%)、天富能源(+10.08%)、横店东磁(+10.06%)、宁波韵升(+10.06%)和康美药业(+10.05%); 跌幅前五名为: 全柴动力(-7.72%)、云南城投(-5.9%)、东旭光电(-5.68%)、聚龙股份(-5.38%)和顺络电子(-5.04%); 五日量比前五名为: 天富能源(7.5)、厦门钨业(7.49)、中色股份(4.69)、包钢股份(4.34)和广日股份(4.34)。
- 上一交易日, 发生大宗交易的标的股票有软控股份、广联达、牧原股份等 5 只。
- 今日共有 4 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, 无大股东增持标的股票, 大股东减持标的股票有豪迈科技等 1 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, 亿纬锂能等 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 78 只标的股票涉及分红送转事件, 其中有广宇发展、本钢板材、长江证券等 35 只股东大会通过, 长春高新、厦门港务、紫光股份等 12 只为实施公告日, 贵航股份、鄂武商 A、太阳纸业等 20 只为股权登记日, 申万宏源、万向钱潮、兴蓉环境等 11 只为除权除息日。
- 今日无标的股票业绩报告发布。
- 未来 7 个交易日共有航天长峰、安泰科技、中国动力等 8 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。
- 今日拟平仓股票有粤电力 A、泰合健康等 2 只。
- 上一交易日组合收益率为 0.02%, 至 2019 年 5 月 16 日组合累计收益率为 133.32%, 分别超越上证综指、沪深 300 及创业板指 87.09、57.62 及 112.52 个百分点。

目录

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

图表目录

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

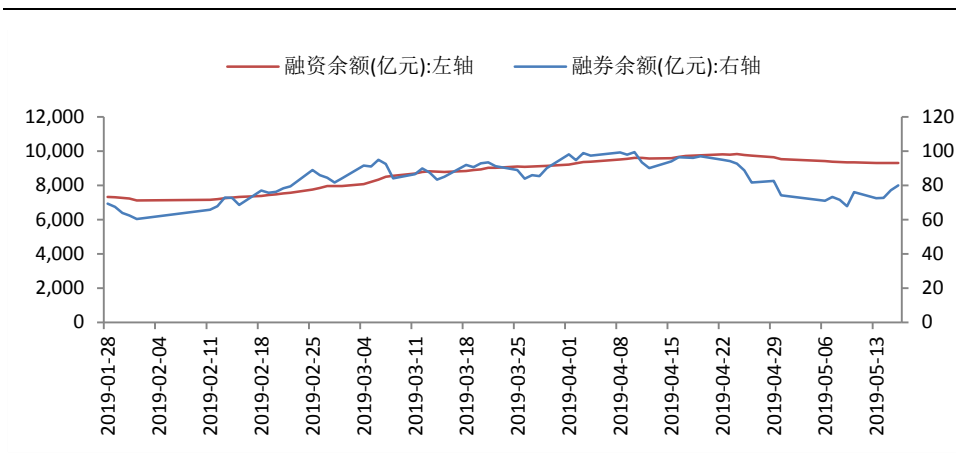
图表 23: 昨日建仓股票	14
图表 24: 昨日平仓股票	14
图表 25: 组合成分股	15

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 9379.35 亿元(+0%)，其中融资余额规模为 9299.45 亿元(-0.03%)，融券余额规模为 79.89 亿元(+3.49%)。

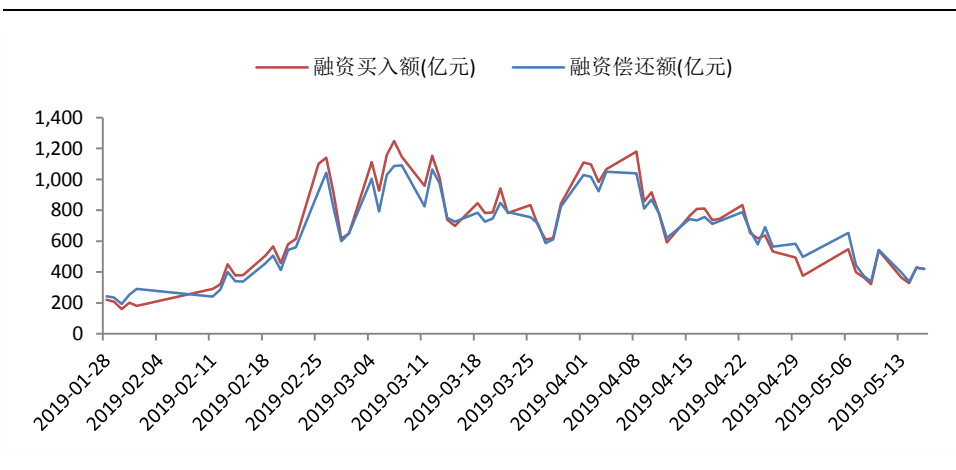
图表 1：近三月每日融资融券余额规模（亿元）



数据来源：Wind、信达证券研发中心

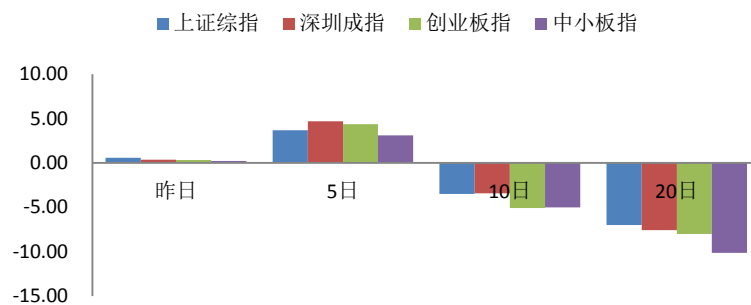
从融资规模来看，上一交易日沪深两市融资买入额为 419.8 亿元(-2.4%)，融资偿还额为 422.25 亿元(-1.45%)。

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，市场指数中上证综指表现较好，上涨 0.58%，中小板指表现最弱，上涨 0.23%；从 5 日涨跌幅看，深证成指表现较好，上涨 4.69%，中小板指表现最弱，上涨 3.12%；从 10 日涨跌幅看，深证成指表现较好，下跌 3.42%，创业板指表现最弱，下跌 5.07%；从 20 日涨跌幅看，上证综指表现较好，下跌 6.99%，中小板指表现最弱，下跌 10.12%。

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，通信(+1.21%)、轻工制造(+0.94%)、计算机(+0.55%)等行业增速居前，休闲服务(-1.94%)、有色金属(-3.12%)、建筑材料(-3.16%)等行业增速靠后。

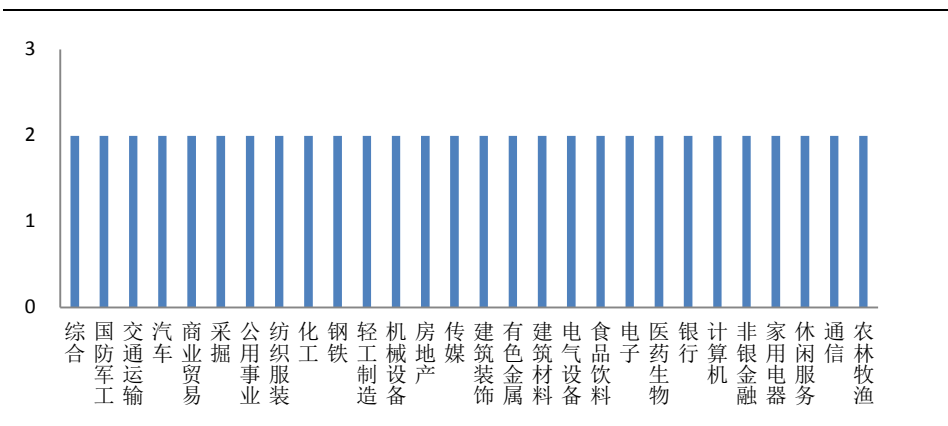
图表 4：上一交易日两融标的股票分行业融资余额占流通市值比例及增速（%）

序号	代码	行业	融资余额占流通市值比例(%)	占比增速(%)
1	801770.SI	通信	6.22	1.21
2	801140.SI	轻工制造	6.23	0.94
3	801750.SI	计算机	7.19	0.55
4	801020.SI	采掘	0.91	0.50
5	801080.SI	电子	4.68	0.49
6	801790.SI	非银金融	2.69	0.09
7	801120.SI	食品饮料	0.95	-0.06
8	801760.SI	传媒	5.33	-0.17
9	801170.SI	交通运输	1.70	-0.43
10	801780.SI	银行	0.92	-0.56
11	801110.SI	家用电器	1.45	-0.57
12	801030.SI	化工	3.41	-0.63
13	801150.SI	医药生物	3.00	-0.72
14	801720.SI	建筑装饰	2.66	-0.78
15	801160.SI	公用事业	2.05	-0.85
16	801130.SI	纺织服装	2.64	-0.91
17	801730.SI	电气设备	3.44	-1.00
18	801200.SI	商业贸易	4.34	-1.04
19	801180.SI	房地产	3.03	-1.05
20	801740.SI	国防军工	4.17	-1.10
21	801890.SI	机械设备	3.40	-1.29
22	801880.SI	汽车	2.39	-1.33
23	801040.SI	钢铁	3.13	-1.35
24	801010.SI	农林牧渔	2.80	-1.42
25	801230.SI	综合	6.36	-1.61
26	801210.SI	休闲服务	0.76	-1.94
27	801050.SI	有色金属	5.31	-3.12
28	801710.SI	建筑材料	3.00	-3.16

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,综合(+1.99%)、国防军工(+1.99%)、交通运输(+1.99%)、汽车(+1.99%)、商业贸易(+1.99%)等行业表现较好,农林牧渔(+1.99%)、通信(+1.99%)、休闲服务(+1.99%)、家用电器(+1.99%)、非银金融(+1.99%)等行业表现较弱。

图表 5: 申万行业上一交易日涨跌幅 (%)

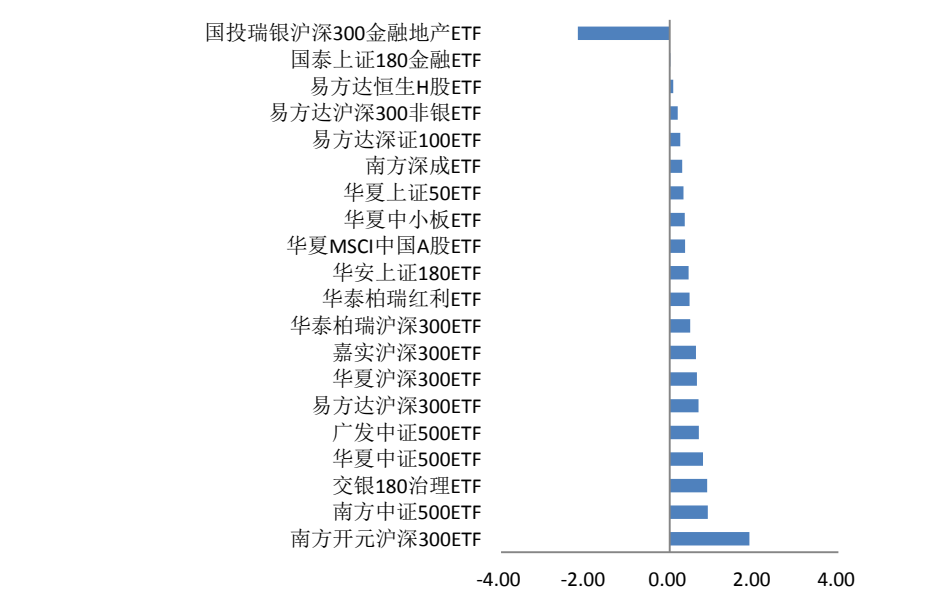


数据来源: Wind、信达证券研发中心

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:南方开元沪深 300ETF (+1.89%)、南方中证 500ETF (+0.9%) 及交银 180 治理 ETF (+0.89%); 跌幅前三名为:国投瑞银沪深 300 金融地产 ETF (-2.17%)、国泰上证 180 金融 ETF (+0.02%) 及易方达恒生 H 股 ETF (+0.08%)。

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:中色股份(+10.11%)、天富能源(+10.08%)、横店东磁(+10.06%)、宁波韵升(+10.06%)和康美药业(+10.05%); 跌幅前五名为:全柴动力(-7.72%)、云南城投(-5.9%)、东旭光电(-5.68%)、聚龙

股份（-5.38%）和顺络电子（-5.04%）。

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	000758.SZ	中色股份	10.11	4.69	600218.SH	全柴动力	-7.72	1.06
2	600509.SH	天富能源	10.08	7.50	600239.SH	云南城投	-5.90	2.28
3	002056.SZ	横店东磁	10.06	4.33	000413.SZ	东旭光电	-5.68	2.99
4	600366.SH	宁波韵升	10.06	3.09	300202.SZ	聚龙股份	-5.38	1.59
5	600518.SH	康美药业	10.05	1.17	002138.SZ	顺络电子	-5.04	2.35
6	600058.SH	五矿发展	10.04	4.32	600703.SH	三安光电	-4.91	1.59
7	600392.SH	盛和资源	10.03	2.11	002475.SZ	立讯精密	-4.63	1.29
8	600549.SH	厦门钨业	10.02	7.49	600775.SH	南京熊猫	-4.61	0.88
9	000957.SZ	中通客车	10.01	2.00	000876.SZ	新希望	-4.14	0.97
10	000970.SZ	中科三环	10.01	3.27	600088.SH	中视传媒	-4.03	1.07
11	600111.SH	北方稀土	10.01	2.15	600146.SH	商赢环球	-4.02	1.11
12	600259.SH	广晟有色	10.01	1.75	300079.SZ	数码科技	-3.38	0.75
13	300122.SZ	智飞生物	9.99	3.17	600575.SH	皖江物流	-3.33	0.86
14	600416.SH	湘电股份	9.97	3.04	000616.SZ	海航投资	-3.30	2.32
15	600331.SH	宏达股份	9.94	3.82	600517.SH	置信电气	-3.26	1.03
16	600010.SH	宝钢股份	9.32	4.34	601777.SH	力帆股份	-3.26	1.15
17	000969.SZ	安泰科技	9.25	2.55	600175.SH	美都能源	-3.20	0.89
18	600592.SH	龙溪股份	9.02	2.03	600026.SH	中远海能	-3.14	1.00
19	600206.SH	有研新材	8.67	2.61	600831.SH	广电网络	-3.03	0.93
20	002355.SZ	兴民智通	8.28	2.27	600570.SH	恒生电子	-2.93	0.91

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：天富能源（7.5）、厦门钨业（7.49）、中色股份（4.69）、宝钢股份（4.34）和广日股份（4.34）。

图表 8：上一交易日五日量比排名前 20 标的股票

排名	五日量比前 20			
	股票代码	股票简称	股价涨幅 (%)	五日量比
1	600509.SH	天富能源	10.08	7.50
2	600549.SH	厦门钨业	10.02	7.49
3	000758.SZ	中色股份	10.11	4.69
4	600010.SH	宝钢股份	9.32	4.34
5	600894.SH	广日股份	4.60	4.34
6	002056.SZ	横店东磁	10.06	4.33
7	600058.SH	五矿发展	10.04	4.32
8	600389.SH	江山股份	6.95	4.09
9	000525.SZ	红太阳	6.00	4.02
10	600331.SH	宏达股份	9.94	3.82
11	002431.SZ	棕榈股份	-2.68	3.39
12	002151.SZ	北斗星通	6.47	3.31
13	000970.SZ	中科三环	10.01	3.27
14	600337.SH	美克家居	8.13	3.24

15	600237.SH	铜峰电子	4.15	3.24
16	300122.SZ	智飞生物	9.99	3.17
17	600366.SH	宁波韵升	10.06	3.09
18	600416.SH	湘电股份	9.97	3.04
19	000413.SZ	东旭光电	-5.68	2.99
20	002378.SZ	章源钨业	6.79	2.87

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: 平安银行(100%)、万科 A(100%)、深振业 A(100%)、神州高铁(100%)、中国宝安(100%)。

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	000001.SZ	平安银行	-0.54	100.00	-148.43
2	000002.SZ	万科 A	0.39	100.00	-11.80
3	000006.SZ	深振业 A	0.52	100.00	12.78
4	000008.SZ	神州高铁	0.00	100.00	-5.64
5	000009.SZ	中国宝安	1.72	100.00	18.43
6	000012.SZ	南玻 A	2.78	100.00	7.38
7	000027.SZ	深圳能源	0.16	100.00	2.03
8	000028.SZ	国药一致	4.53	100.00	4.55
9	000030.SZ	富奥股份	0.00	100.00	-2.58
10	000031.SZ	大悦城	0.29	100.00	-4.63
11	000036.SZ	华联控股	1.78	100.00	8.06
12	000039.SZ	中集集团	1.01	100.00	8.14
13	000040.SZ	东旭蓝天	0.40	100.00	13.46
14	000043.SZ	中航善达	1.95	100.00	-19.90
15	000046.SZ	泛海控股	-0.15	100.00	-5.65
16	000049.SZ	德赛电池	0.96	100.00	-4.50
17	000050.SZ	深天马 A	0.22	100.00	-26.66
18	000059.SZ	华锦股份	-0.14	100.00	-16.52
19	000060.SZ	中金岭南	3.27	100.00	28.04
20	000061.SZ	农产品	2.05	100.00	-1.17

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: 平安银行(61.92%)、万科 A(61.92%)、深振业 A(61.92%)、神州高铁(61.92%)、中国宝安(61.92%); 尾盘金额流入率最高的前五名是: 平安银行(14.7%)、万科 A(14.7%)、深振业 A(14.7%)、神州高铁(14.7%)、中国宝安(14.7%)。

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	000001.SZ	平安银行	-0.54	61.92	0.79	000001.SZ	平安银行	-0.54	14.70	9.22
2	000002.SZ	万科 A	0.39	61.92	0.79	000002.SZ	万科 A	0.39	14.70	9.22
3	000006.SZ	深振业 A	0.52	61.92	0.79	000006.SZ	深振业 A	0.52	14.70	9.22
4	000008.SZ	神州高铁	0.00	61.92	0.79	000008.SZ	神州高铁	0.00	14.70	9.22
5	000009.SZ	中国宝安	1.72	61.92	0.79	000009.SZ	中国宝安	1.72	14.70	9.22
6	000012.SZ	南玻 A	2.78	61.92	0.79	000012.SZ	南玻 A	2.78	14.70	9.22

7	000027.SZ	深圳能源	0.16	61.92	0.79	000027.SZ	深圳能源	0.16	14.70	9.22
8	000028.SZ	国药一致	4.53	61.92	0.79	000028.SZ	国药一致	4.53	14.70	9.22
9	000030.SZ	富奥股份	0.00	61.92	0.79	000030.SZ	富奥股份	0.00	14.70	9.22
10	000031.SZ	大悦城	0.29	61.92	0.79	000031.SZ	大悦城	0.29	14.70	9.22
11	000036.SZ	华联控股	1.78	61.92	0.79	000036.SZ	华联控股	1.78	14.70	9.22
12	000039.SZ	中集集团	1.01	61.92	0.79	000039.SZ	中集集团	1.01	14.70	9.22
13	000040.SZ	东旭蓝天	0.40	61.92	0.79	000040.SZ	东旭蓝天	0.40	14.70	9.22
14	000043.SZ	中航善达	1.95	61.92	0.79	000043.SZ	中航善达	1.95	14.70	9.22
15	000046.SZ	泛海控股	-0.15	61.92	0.79	000046.SZ	泛海控股	-0.15	14.70	9.22
16	000049.SZ	德赛电池	0.96	61.92	0.79	000049.SZ	德赛电池	0.96	14.70	9.22
17	000050.SZ	深天马 A	0.22	61.92	0.79	000050.SZ	深天马 A	0.22	14.70	9.22
18	000059.SZ	华锦股份	-0.14	61.92	0.79	000059.SZ	华锦股份	-0.14	14.70	9.22
19	000060.SZ	中金岭南	3.27	61.92	0.79	000060.SZ	中金岭南	3.27	14.70	9.22
20	000061.SZ	农产品	2.05	61.92	0.79	000061.SZ	农产品	2.05	14.70	9.22

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是和佳股份(21.86%)、恒泰艾普(21.84%)、卓翼科技(20.62%)等,融资余额占流通市值比例增速前十名是美克家居(+24.11%)、恒瑞医药(+14.77%)、广晟有色(+13.1%)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	300273.SZ	和佳股份	21.86	600337.SH	美克家居	24.11
2	300157.SZ	恒泰艾普	21.84	600276.SH	恒瑞医药	14.77
3	002369.SZ	卓翼科技	20.62	600259.SH	广晟有色	13.10
4	300079.SZ	数码科技	18.38	000596.SZ	古井贡酒	11.90
5	600470.SH	六国化工	18.31	601857.SH	中国石油	10.85
6	600692.SH	亚通股份	17.56	600088.SH	中视传媒	10.73
7	600218.SH	全柴动力	16.73	600741.SH	华域汽车	10.53
8	600668.SH	尖峰集团	16.54	300202.SZ	聚龙股份	7.85
9	002325.SZ	洪涛股份	16.51	601199.SH	江南水务	6.88
10	000551.SZ	创元科技	16.43	600744.SH	华银电力	6.84

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软控股份、广联达、牧原股份等 5 只。

图表 12: 上一交易日发生大宗交易标的股票

编号	股票代码	股票简称	成交价	前一交易日收盘价	折价率 (%)	当日收盘价	成交量(万股/份/张)	成交额(万元)
1	002073.SZ	软控股份	5.00	5.51	-9.26	5.55	56.50	282.50
2	002410.SZ	广联达	26.27	28.55	-7.99	28.85	126.00	3310.02
3	002714.SZ	牧原股份	54.59	60.65	-9.99	61.61	360.00	19652.40
4	600151.SH	航天机电	5.57	5.57	0.00	5.57	1175.95	6550.07
5	601328.SH	交通银行	6.00	6.00	0.00	6.00	50.00	300.00

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 4 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	000538.SZ	云南白药	停牌	2019-05-16	1	0.58	重大事项
2	002579.SZ	中京电子	停牌	2019-05-13	4	0.56	重大事项
3	000333.SZ	美的集团	停牌	2019-05-08	9	1.00	重大事项
4	600277.SH	亿利洁能	停牌	2019-05-07	10	1.69	拟筹划重大资产重组

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，无大股东增持标的股票，大股东减持标的股票有豪迈科技等 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 (%)	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	002595.SZ	豪迈科技	2019/5/17	2019/5/7	减持	0.01	0.00	5.00	20.51	20.88	0.05
2	002595.SZ	豪迈科技	2019/5/17	2019/5/6	减持	0.03	0.00	5.01	20.59	20.61	0.05
3	002595.SZ	豪迈科技	2019/5/17	2019/4/25	减持	0.05	0.00	5.02	19.65	19.65	0.05
4	002595.SZ	豪迈科技	2019/5/17	2019/4/24	减持	0.06	0.00	5.06	19.32	19.40	0.05
5	002595.SZ	豪迈科技	2019/5/17	2019/4/23	减持	0.0747	0.00	5.10	19.64	19.68	
6	002595.SZ	豪迈科技	2019/5/17	2019/4/22	减持	0.08	0.00	5.14	19.69	19.77	0.05
7	002595.SZ	豪迈科技	2019/5/17	2019/4/19	减持	0.004	0	5.1999	20.03	20.0719	
8	002595.SZ	豪迈科技	2019/5/17	2019/4/18	减持	0.0023	0.00	5.20	20.29	20.36	
9	002595.SZ	豪迈科技	2019/5/17	2019/4/17	减持	0.0143	0	5.2041	20.41	20.4742	
10	002595.SZ	豪迈科技	2019/5/17	2019/4/16	减持	0.01	0.00	5.21	20.13	19.90	0.05
11	002595.SZ	豪迈科技	2019/5/17	2019/4/15	减持	0.0061	0.00	5.22	20.81	20.54	
12	002595.SZ	豪迈科技	2019/5/17	2019/4/12	减持	0.00	0.00	5.22	21.11	20.96	0.05
13	002595.SZ	豪迈科技	2019/5/17	2019/4/11	减持	0.0133	0	5.2238	21.16	21.2791	
14	002595.SZ	豪迈科技	2019/5/17	2019/4/10	减持	0.01	0.00	5.23	21.48	21.59	0.05
15	002595.SZ	豪迈科技	2019/5/17	2019/4/9	减持	0.01	0.00	5.24	21.44	21.44	0.05
16	002595.SZ	豪迈科技	2019/5/17	2019/4/8	减持	0.0342	0.00	5.24	21.68	22.00	
17	002595.SZ	豪迈科技	2019/5/17	2019/4/4	减持	0.04	0.00	5.27	21.09	21.15	0.05
18	002595.SZ	豪迈科技	2019/5/17	2019/4/3	减持	0.04	0.00	5.29	21.41	21.47	0.05
19	002595.SZ	豪迈科技	2019/5/17	2019/2/20	减持	0.0432	0	5.3195	17.68	17.6856	
20	002595.SZ	豪迈科技	2019/5/17	2019/2/19	减持	0.03	0.00	5.35	17.94	17.87	0.05

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，其中没有股票涉及董事会预案，没有

股票涉及股东大会通过，亿纬锂能等 1 只为增发公告日，没有股票涉及增发股份上市日。

图表 15：未来七个交易目标的股票增发

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	300014.SZ	亿纬锂能	2019-05-17	增发公告日	21.74	定向	27.48	0.18

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 78 只标的股票涉及分红送转事件，其中有广宇发展、本钢板材、长江证券等 35 只股东大会通过，长春高新、厦门港务、紫光股份等 12 只为实施公告日，贵航股份、鄂武商 A、太阳纸业等 20 只为股权登记日，申万宏源、万向钱潮、兴蓉环境等 11 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	000661.SZ	长春高新	2019/5/17	是	0.80	实施公告日	318.78	2.71	0.25	
2	000905.SZ	厦门港务	2019/5/17	是	0.01	实施公告日	7.92	1.28	0.13	
3	000938.SZ	紫光股份	2019/5/17	是	0.15	实施公告日	37.82	-1.07	0.40	0.40
4	002032.SZ	苏泊尔	2019/5/17	是	1.02	实施公告日	68.05	0.74	1.50	
5	002056.SZ	横店东磁	2019/5/17	是	0.15	实施公告日	7.22	10.06	2.07	
6	002285.SZ	世联行	2019/5/17	是	0.02	实施公告日	5.00	0.00	0.42	
7	002317.SZ	众生药业	2019/5/17	是	0.20	实施公告日	9.02	2.15	2.22	
8	002415.SZ	海康威视	2019/5/17	是	0.60	实施公告日	28.63	-0.52	2.10	
9	600176.SH	中国巨石	2019/5/17	是	0.23	实施公告日	9.84	0.82	2.29	
10	600438.SH	通威股份	2019/5/17	是	0.16	实施公告日	16.18	-2.24	0.99	
11	601318.SH	中国平安	2019/5/17	是	1.10	实施公告日	80.97	0.53	1.36	
12	601636.SH	旗滨集团	2019/5/17	是	0.30	实施公告日	4.05	2.53	7.41	
13	600523.SH	贵航股份	2019/5/23	是	0.15	股权登记日	13.20	2.33	1.14	
14	000501.SZ	鄂武商 A	2019/5/22	是	0.20	股权登记日	11.31	0.27	1.77	
15	002078.SZ	太阳纸业	2019/5/22	是	0.10	股权登记日	6.84	-0.15	1.46	
16	002416.SZ	爱施德	2019/5/22	是	0.20	股权登记日	5.73	0.70	3.49	
17	600008.SH	首创股份	2019/5/22	是	0.08	股权登记日	3.58	0.28	2.23	
18	600113.SH	浙江东日	2019/5/22	是	0.04	股权登记日	7.90	3.00	0.51	
19	600230.SH	沧州大化	2019/5/22	是	0.20	股权登记日	16.79	1.51	1.19	
20	600667.SH	太极实业	2019/5/22	是	0.14	股权登记日	6.71	0.15	2.04	
21	600867.SH	通化东宝	2019/5/22	是	0.20	股权登记日	14.58	1.89	1.37	
22	000708.SZ	大冶特钢	2019/5/21	是	0.80	股权登记日	14.13	3.97	5.66	
23	000902.SZ	新洋丰	2019/5/21	是	0.20	股权登记日	10.47	-0.66	1.91	
24	002110.SZ	三钢闽光	2019/5/21	是	2.00	股权登记日	18.23	1.79	10.97	0.50
25	300059.SZ	东方财富	2019/5/21	是	0.02	股权登记日	15.57	-1.21	0.13	0.20
26	600598.SH	北大荒	2019/5/21	是	0.40	股权登记日	11.28	5.42	3.55	
27	000069.SZ	华侨城 A	2019/5/20	是	0.30	股权登记日	7.49	0.27	4.01	
28	002277.SZ	友阿股份	2019/5/20	是	0.05	股权登记日	3.66	0.83	1.37	
29	600206.SH	有研新材	2019/5/20	是	0.01	股权登记日	9.28	8.67	0.06	
30	600252.SH	中恒集团	2019/5/20	是	0.06	股权登记日	3.07	1.32	1.95	

31	600728.SH	佳都科技	2019/5/20	是	0.06	股权登记日	10.55	1.93	0.54	
32	603369.SH	今世缘	2019/5/20	是	0.33	股权登记日	28.51	0.46	1.16	
33	000537.SZ	广宇发展	2019/5/17	是		股东大会通过	7.58	1.74		
34	000761.SZ	本钢板材	2019/5/17	是		股东大会通过	4.37	2.58		
35	000783.SZ	长江证券	2019/5/17	是		股东大会通过	7.68	-0.13		
36	000961.SZ	中南建设	2019/5/17	是		股东大会通过	8.70	-0.46		
37	000983.SZ	西山煤电	2019/5/17	是		股东大会通过	6.36	3.58		
38	002091.SZ	江苏国泰	2019/5/17	是		股东大会通过	6.17	0.65		
39	002142.SZ	宁波银行	2019/5/17	是		股东大会通过	22.69	0.44		
40	002146.SZ	荣盛发展	2019/5/17	是		股东大会通过	9.96	1.22		
41	002153.SZ	石基信息	2019/5/17	是		股东大会通过	29.42	-0.61		
42	002250.SZ	联化科技	2019/5/17	是		股东大会通过	10.73	-1.74		
43	002367.SZ	康力电梯	2019/5/17	是		股东大会通过	8.27	1.22		
44	002371.SZ	北方华创	2019/5/17	是		股东大会通过	66.97	-1.93		
45	002439.SZ	启明星辰	2019/5/17	是		股东大会通过	25.28	-1.63		
46	002508.SZ	老板电器	2019/5/17	是		股东大会通过	27.41	-0.22		
47	002521.SZ	齐峰新材	2019/5/17	是		股东大会通过	5.66	1.25		
48	300088.SZ	长信科技	2019/5/17	是		股东大会通过	5.19	0.58		
49	300168.SZ	万达信息	2019/5/17	是		股东大会通过	13.78	-0.58		
50	300170.SZ	汉得信息	2019/5/17	是		股东大会通过	14.38	-1.98		
51	300355.SZ	蒙草生态	2019/5/17	是		股东大会通过	4.54	0.00		
52	600037.SH	歌华有线	2019/5/17	是		股东大会通过	10.85	-1.27		
53	600197.SH	伊力特	2019/5/17	是		股东大会通过	17.70	0.23		
54	600261.SH	阳光照明	2019/5/17	是		股东大会通过	3.76	-0.27		
55	600285.SH	羚锐制药	2019/5/17	是		股东大会通过	8.93	1.82		
56	600366.SH	宁波韵升	2019/5/17	是		股东大会通过	7.33	10.06		
57	600409.SH	三友化工	2019/5/17	是		股东大会通过	6.25	1.30		
58	600509.SH	天富能源	2019/5/17	是		股东大会通过	5.68	10.08		
59	600565.SH	迪马股份	2019/5/17	是		股东大会通过	4.08	1.24		
60	600572.SH	康恩贝	2019/5/17	是		股东大会通过	7.85	0.64		
61	600606.SH	绿地控股	2019/5/17	是		股东大会通过	7.14	0.71		
62	600743.SH	华远地产	2019/5/17	是		股东大会通过	2.74	0.74		
63	600797.SH	浙大网新	2019/5/17	是		股东大会通过	9.71	0.00		
64	601199.SH	江南水务	2019/5/17	是		股东大会通过	4.04	-1.46		
65	601388.SH	怡球资源	2019/5/17	是		股东大会通过	2.09	4.50		
66	601933.SH	永辉超市	2019/5/17	是		股东大会通过	10.14	2.53		
67	601999.SH	出版传媒	2019/5/17	是		股东大会通过	6.31	2.60		
68	000166.SZ	申万宏源	2019/5/17	是	0.05	除权除息日	4.81	0.63	1.04	
69	000559.SZ	万向钱潮	2019/5/17	是	0.20	除权除息日	6.56	0.61	3.05	
70	000598.SZ	兴蓉环境	2019/5/17	是	0.07	除权除息日	4.58	0.44	1.44	
71	000739.SZ	普洛药业	2019/5/17	是	0.11	除权除息日	10.04	2.03	1.10	
72	002049.SZ	紫光国微	2019/5/17	是	0.06	除权除息日	41.07	-1.18	0.14	
73	002179.SZ	中航光电	2019/5/17	是	0.13	除权除息日	43.41	0.25	0.30	0.30
74	002244.SZ	滨江集团	2019/5/17	是	0.06	除权除息日	4.40	1.62	1.36	
75	600171.SH	上海贝岭	2019/5/17	是	0.05	除权除息日	13.88	-2.12	0.32	
76	600481.SH	双良节能	2019/5/17	是	0.12	除权除息日	4.08	0.00	2.94	

77	600765.SH	中航重机	2019/5/17	是	0.04	除权除息日	9.57	1.81	0.45	
78	600987.SH	航民股份	2019/5/17	是	0.28	除权除息日	10.50	-0.19	2.67	0.45

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 个交易日共有航天长峰、安泰科技、中国动力等 8 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	600855.SH	航天长峰	2019/5/17	1137.18	3.44	定向增发机构配售股份	14.16	2.24
2	000969.SZ	安泰科技	2019/5/20	3764.50	3.81	定向增发机构配售股份	9.21	9.25
3	600482.SH	中国动力	2019/5/20	75026.56	84.20	定向增发机构配售股份	22.42	0.00
4	600811.SH	东方集团	2019/5/27	44110.28	13.48	定向增发机构配售股份	3.84	0.52
5	601636.SH	旗滨集团	2019/5/27	2364.00	0.91	股权激励限售股份	4.05	2.53
6	002439.SZ	启明星辰	2019/5/27	1034.91	1.66	定向增发机构配售股份	25.28	-1.63
7	600999.SH	招商证券	2019/5/27	81530.86	16.63	定向增发机构配售股份	16.11	-0.19
8	600481.SH	双良节能	2019/5/28	1690.00	1.04	股权激励限售股份	4.08	0.00

数据来源: Wind、信达证券研发中心

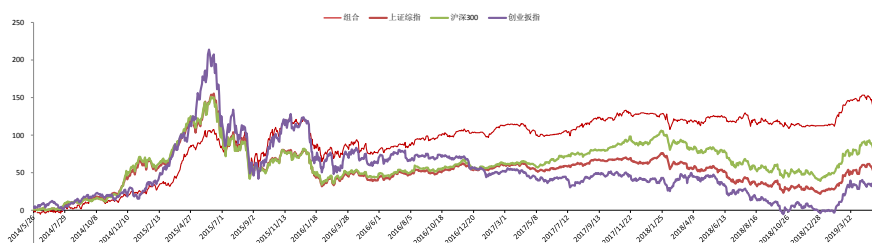
三、事件投资组合操作

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 0.02%, 至 2019 年 5 月 16 日组合累计收益率为 133.32%, 分别超越上证综指、沪深 300 及创业板指 87.09、57.62 及 112.52 个百分点。

图表 19: 组合历史收益曲线



数据来源: Wind、信达证券研发中心

图表 20: 组合历史收益对比

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	-6.65	4.55	8.81	4.72	9.98
上证综指	2.14	-8.83	11.37	12.36	-6.56	-4.77
沪深 300	2.09	-8.37	13.23	16.81	-3.33	13.11
创业板指	3.50	-11.18	16.53	12.05	-16.41	-21.83

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

今日拟平仓股票有粤电力 A、泰合健康等 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	000539.SZ	粤电力 A	2019/4/12	3.00	-14.25
2	000790.SZ	泰合健康	2019/4/12	3.00	-6.38

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

昨日平仓股票有穗恒运 A、苏州固锝等 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	000531.SZ	穗恒运 A	2019/04/11	8.47	3.00	8.10	-4.32
2	002079.SZ	苏州固锝	2019/04/11	7.53	3.00	7.12	-5.39

数据来源: Wind、信达证券研发中心

4. 组合成分股

至 2019 年 5 月 16 日收盘, 组合共有成分股 12 只, 仓位 36%。

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	000539.SZ	粤电力 A	2019/4/12	5.01	3.00	4.30	-14.25	-6.91
2	000790.SZ	泰合健康	2019/4/12	5.24	3.00	4.91	-6.38	0.96
3	000988.SZ	华工科技	2019/4/12	15.36	3.00	13.79	-10.20	-2.86
4	600064.SH	南京高科	2019/4/12	11.90	3.00	10.92	-8.22	-0.88
5	000009.SZ	中国宝安	2019/4/15	6.72	3.00	5.91	-12.08	-4.78
6	000046.SZ	泛海控股	2019/4/15	8.05	3.00	6.69	-16.90	-9.59
7	000425.SZ	徐工机械	2019/4/15	5.12	3.00	4.57	-10.81	-3.50
8	600031.SH	三一重工	2019/4/15	13.28	3.00	12.15	-8.54	-1.23
9	000415.SZ	渤海租赁	2019/4/16	4.97	3.00	4.21	-15.36	-8.38
10	600655.SH	豫园股份	2019/4/16	9.96	3.00	8.77	-11.96	-4.97
11	002648.SZ	卫星石化	2019/4/18	20.40	3.00	15.66	-23.23	-13.81
12	601628.SH	中国人寿	2019/4/19	31.13	3.00	26.03	-16.38	-7.32

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