

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28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 9286.11 亿元(+0.54%), 其中融资余额规模为 9209.14 亿元(+0.49%), 融券余额规模为 76.97 亿元(+6.46%)。从融资规模来看, 上一交易日沪深两市融资买入额为 388.83 亿元(+48.9%), 融资偿还额为 343.52 亿元(+13.05%)。
- 上一交易日, 市场指数中创业板指(+3.34%)表现最好, 上证综指(+1.38%)表现最弱。
- 两融标的股票中, 涨幅前五名为: 誉衡药业(+10.08%)、太极实业(+10.05%)、三安光电(+10.04%)、有研新材(+10.02%)和士兰微(+10.01%); 跌幅前五名为: 兴民智通(-7.21%)、华东医药(-7.05%)、奥瑞金(-5.33%)、康美药业(-4.99%)和立思辰(-2.94%); 五日量比前五名为: 奥瑞金(7.13)、西部资源(3.23)、华东医药(3.08)、一汽富维(2.9)和康美药业(2.71)。
- 上一交易日, 发生大宗交易的标的股票有凯乐科技、温氏股份、牧原股份等9只。
- 今日共有3只标的股票停牌, 其中今日开始停牌股票有深圳华强等1只, 今日无复牌股票。
- 今日披露, 大股东增持标的股票有宝新能源等1只, 无大股东减持标的股票。
- 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, 中信证券等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70只标的股票涉及分红送转事件, 其中有国轩高科、洪涛股份、以岭药业等4只股东大会通过, 世荣兆业、上海钢联、安琪酵母等6只为实施公告日, 太钢不锈钢、国金证券、济川药业等53只为股权登记日, 深天马A、冀东水泥、柳工等7只为除权除息日。
- 今日无标的股票业绩报告发布。
- 未来7个交易日共有领益智造、双良节能、三聚环保等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。
- 今日拟平仓股票有三一重工等1只。
- 上一交易日组合收益率为0.77%, 至2019年5月27日组合累计收益率为130.46%, 分别超越上证综指、沪深300及创业板指87.37、59.77及112.94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. 行业融资规模及指数表现.....	4
3. 标的 ETF 基金表现.....	5
4. 标的股票表现及融资规模.....	5
5. 标的股票大宗交易.....	7
二、今日标的股票事件提示.....	7
1. 标的股票停复牌.....	7
2. 大股东增减持标的股票.....	7
3. 标的股票增发.....	8
4. 标的股票分红送转.....	8
5. 发布相关业绩报告的标的股票.....	10
6. 标的股票限售股解禁.....	10
三、事件投资组合操作.....	10
1. 组合历史收益.....	10
2. 今日组合操作.....	11
3. 昨日组合操作回顾.....	11
4. 组合成分股.....	11

图表目录

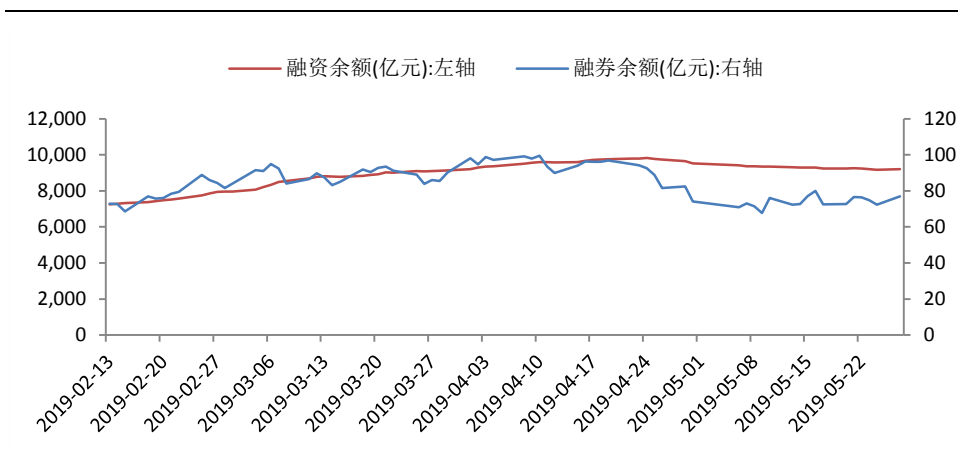
图表 1: 近三月每日融资融券余额规模 (亿元)	3
图表 2: 近三月每日融资买入额及偿还额 (亿元)	3
图表 3: 近期主要市场指数涨跌幅 (%)	4
图表 4: 上一交易日两融标的股票分行业融资余额占流通市值比例及增速 (%)	4
图表 5: 融资融券 ETF 上一交易日涨跌幅 (%)	5
图表 6: 上一交易日涨跌幅排名前 20 标的股票.....	5
图表 7: 上一交易日五日量比排名前 20 标的股票.....	6
图表 8: 上一交易日融资余额占流通市值比例及增速排名前 10 标的股票.....	6
图表 9: 上一交易日发生大宗交易标的股票.....	7
图表 10: 复牌及停牌标的股票.....	7
图表 11: 大股东持股比例变动标的股票.....	7
图表 12: 未来七个交易日的股票增发.....	8
图表 13: 未来七个交易日发生分红送转事件标的股票.....	8
图表 14: 今日发布相关业绩报告的标的股票.....	10
图表 15: 未来七个交易日的股票限售解禁.....	10
图表 16: 组合历史收益曲线.....	10
图表 17: 组合历史收益对比.....	11
图表 18: 今日拟建仓股票.....	11
图表 19: 今日拟平仓股票.....	11
图表 20: 昨日建仓股票.....	11
图表 21: 昨日平仓股票.....	11
图表 22: 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 9286.11 亿元(+0.54%)，其中融资余额规模为 9209.14 亿元(+0.49%)，融券余额规模为 76.97 亿元(+6.46%)。

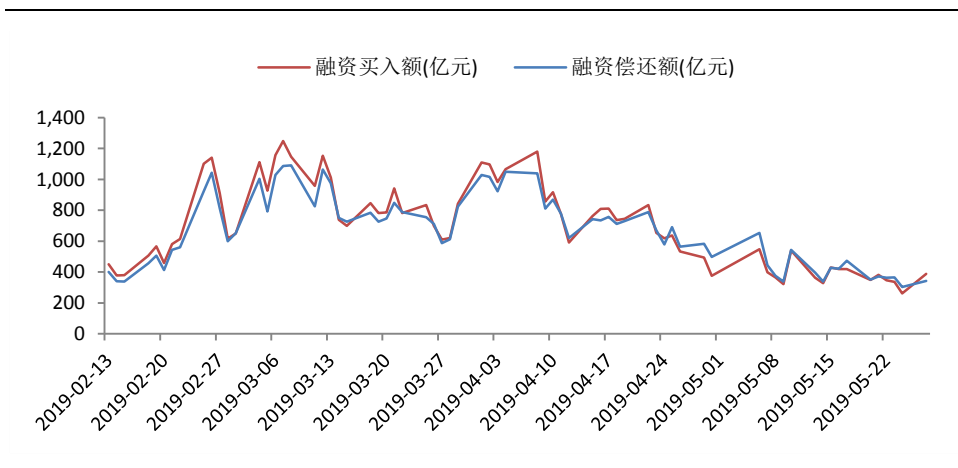
图表 1：近三月每日融资融券余额规模（亿元）



数据来源：Wind、信达证券研发中心

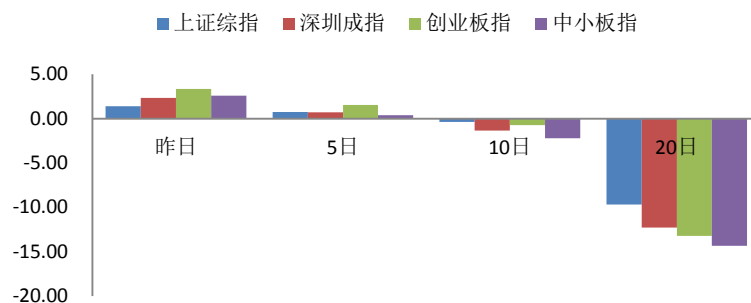
从融资规模来看，上一交易日沪深两市融资买入额为 388.83 亿元(+48.9%)，融资偿还额为 343.52 亿元(+13.05%)。

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 3.34%，上证综指表现最弱，上涨 1.38%；从 5 日涨跌幅看，创业板指表现较好，上涨 1.54%，中小板指表现最弱，上涨 0.39%；从 10 日涨跌幅看，上证综指表现较好，下跌 0.39%，中小板指表现最弱，下跌 2.21%；从 20 日涨跌幅看，上证综指表现较好，下跌 9.66%，中小板指表现最弱，下跌 14.31%。

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，家用电器(+0.96%)、食品饮料(+0.42%)、纺织服装(-0.16%)等行业增速居前，轻工制造(-3.57%)、计算机(-3.61%)、农林牧渔(-4.19%)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（%）

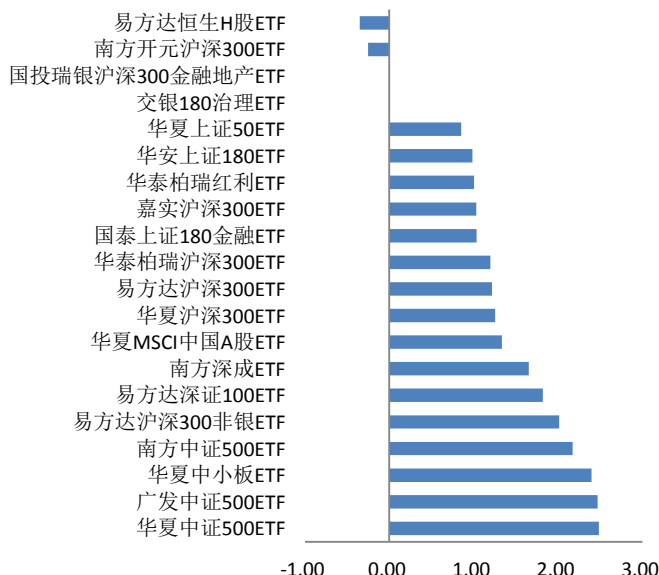
序号	代码	行业	融资余额占流通市值比例(%)	占比增速(%)
1	801110.SI	家用电器	1.48	0.96
2	801120.SI	食品饮料	1.00	0.42
3	801130.SI	纺织服装	2.68	-0.16
4	801780.SI	银行	0.89	-0.18
5	801710.SI	建筑材料	3.03	-0.30
6	801170.SI	交通运输	1.74	-0.37
7	801880.SI	汽车	2.53	-0.40
8	801020.SI	采掘	0.90	-0.46
9	801150.SI	医药生物	3.08	-0.95
10	801180.SI	房地产	3.11	-0.97
11	801160.SI	公用事业	2.02	-1.17
12	801210.SI	休闲服务	0.75	-1.19
13	801030.SI	化工	3.41	-1.22
14	801720.SI	建筑装饰	2.70	-1.32
15	801040.SI	钢铁	3.15	-1.34
16	801730.SI	电气设备	3.61	-1.39
17	801790.SI	非银金融	2.68	-1.66
18	801760.SI	传媒	5.44	-1.71
19	801200.SI	商业贸易	4.46	-1.81
20	801890.SI	机械设备	3.38	-1.82
21	801050.SI	有色金属	5.36	-1.93
22	801080.SI	电子	4.85	-2.36
23	801740.SI	国防军工	4.20	-2.71
24	801230.SI	综合	6.45	-2.89
25	801770.SI	通信	6.12	-3.22
26	801140.SI	轻工制造	6.29	-3.57
27	801750.SI	计算机	7.09	-3.61
28	801010.SI	农林牧渔	2.85	-4.19

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: 华夏中证 500ETF (+2.49%)、广发中证 500ETF (+2.47%) 及华夏中小板 ETF (+2.4%)。跌幅前三名为: 易方达恒生 H 股 ETF (-0.35%)、南方开元沪深 300ETF (-0.25%) 及国投瑞银沪深 300 金融地产 ETF (+0%)。

图表 5: 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: 誉衡药业 (+10.08%)、太极实业 (+10.05%)、三安光电 (+10.04%)、有研新材 (+10.02%) 和士兰微 (+10.01%); 跌幅前五名为: 兴民智通 (-7.21%)、华东医药 (-7.05%)、奥瑞金 (-5.33%)、康美药业 (-4.99%) 和立思辰 (-2.94%)。

图表 6: 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	002437.SZ	誉衡药业	10.08	1.69	002355.SZ	兴民智通	-7.21	2.20
2	600667.SH	太极实业	10.05	1.26	000963.SZ	华东医药	-7.05	3.08
3	600703.SH	三安光电	10.04	1.28	002701.SZ	奥瑞金	-5.33	7.13
4	600206.SH	有研新材	10.02	1.46	600518.SH	康美药业	-4.99	2.71
5	600460.SH	士兰微	10.01	0.96	300010.SZ	立思辰	-2.94	1.48
6	600536.SH	中国软件	10.00	1.06	600139.SH	西部资源	-2.81	3.23
7	002161.SZ	远望谷	10.00	0.49	601009.SH	南京银行	-2.11	1.60
8	600171.SH	上海贝岭	9.99	1.27	600729.SH	重庆百货	-2.01	1.16
9	600584.SH	长电科技	9.98	0.60	600418.SH	江淮汽车	-1.47	1.48
10	600800.SH	天津磁卡	9.98	1.80	000800.SZ	一汽轿车	-1.47	1.50
11	600523.SH	贵航股份	9.97	1.87	600742.SH	一汽富维	-1.33	2.90
12	300053.SZ	欧比特	9.96	1.44	002367.SZ	康力电梯	-1.30	1.19

13	600175.SH	美都能源	9.92	0.78	002563.SZ	森马服饰	-1.06	1.11
14	002079.SZ	苏州固锝	9.05	1.11	603766.SH	隆鑫通用	-0.93	2.13
15	002714.SZ	牧原股份	8.67	1.54	601398.SH	工商银行	-0.88	1.05
16	300014.SZ	亿纬锂能	8.65	1.64	600872.SH	中炬高新	-0.87	1.16
17	300033.SZ	同花顺	8.58	1.59	601238.SH	广汽集团	-0.74	1.83
18	002151.SZ	北斗星通	8.38	1.14	600004.SH	白云机场	-0.74	1.03
19	002600.SZ	领益智造	8.35	1.14	601166.SH	兴业银行	-0.71	2.00
20	002023.SZ	海特高新	8.15	0.91	601018.SH	宁波港	-0.63	0.97

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: 奥瑞金 (7.13)、西部资源 (3.23)、华东医药 (3.08)、一汽富维 (2.9) 和康美药业 (2.71)。

图表 7: 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	002701.SZ	奥瑞金	-5.33	7.13
2	600139.SH	西部资源	-2.81	3.23
3	000963.SZ	华东医药	-7.05	3.08
4	600742.SH	一汽富维	-1.33	2.90
5	600518.SH	康美药业	-4.99	2.71
6	000006.SZ	深振业 A	4.54	2.60
7	600580.SH	卧龙电驱	6.34	2.43
8	000776.SZ	广发证券	1.53	2.41
9	002202.SZ	金风科技	5.97	2.41
10	002579.SZ	中京电子	2.05	2.40
11	001896.SZ	豫能控股	2.83	2.31
12	002646.SZ	青青稞酒	1.68	2.24
13	002355.SZ	兴民智通	-7.21	2.20
14	603766.SH	隆鑫通用	-0.93	2.13
15	601198.SH	东兴证券	5.45	2.09
16	000338.SZ	潍柴动力	4.26	2.07
17	600875.SH	东方电气	7.89	2.05
18	300058.SZ	蓝色光标	7.36	2.05
19	601126.SH	四方股份	0.65	2.01
20	601166.SH	兴业银行	-0.71	2.00

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恒泰艾普(22.16%)、和佳股份(21.89%)、卓翼科技(19.56%)等, 融资余额占流通市值比例增速前十名森马服饰(+13.11%)、兴民智通(+10.72%)、隆基股份(+9.19%)等。

图表 8: 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	300157.SZ	恒泰艾普	22.16	002563.SZ	森马服饰	13.11
2	300273.SZ	和佳股份	21.89	002355.SZ	兴民智通	10.72
3	002369.SZ	卓翼科技	19.56	601012.SH	隆基股份	9.19
4	600470.SH	六国化工	19.36	002367.SZ	康力电梯	6.68

5	300079.SZ	数码科技	18.19	000963.SZ	华东医药	6.43
6	600692.SH	亚通股份	17.35	002646.SZ	青青稞酒	6.38
7	000790.SZ	泰合健康	17.24	601009.SH	南京银行	5.78
8	002325.SZ	洪涛股份	16.79	600600.SH	青岛啤酒	4.92
9	600218.SH	全柴动力	16.55	600309.SH	万华化学	4.60
10	000551.SZ	创元科技	16.31	000957.SZ	中通客车	4.53

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凯乐科技、温氏股份、牧原股份等 9 只。

图表 9: 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	600260.SH	凯乐科技	15.53	17.25	-9.97	17.83	121.00	1879.13
2	300498.SZ	温氏股份	30.33	33.70	-10.00	35.85	18.02	609.47
3	002714.SZ	牧原股份	48.70	54.11	-10.00	58.80	800.00	38960.00
4	002572.SZ	索菲亚	19.55	19.35	1.03	19.55	36.40	711.62
5	002385.SZ	大北农	5.49	5.24	4.77	5.55	450.00	2470.50
6	000667.SZ	美好置业	2.59	2.73	-5.13	2.74	1235.20	3199.16
7	000100.SZ	TCL 集团	2.94	3.27	-10.09	3.39	200.00	588.00
8	600570.SH	恒生电子	63.97	61.65	3.76	63.97	6.50	415.81
9	601328.SH	交通银行	5.99	5.99	0.00	5.99	50.00	299.50

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 3 只标的股票停牌, 其中今日开始停牌股票有深圳华强等 1 只, 今日无复牌股票。

图表 10: 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	000062.SZ	深圳华强	停牌	2019-05-28	0	0.00	
2	002049.SZ	紫光国微	停牌	2019-05-20	8	0.35	重大资产重组
3	000538.SZ	云南白药	停牌	2019-05-16	12	-1.58	重大事项

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宝新能源等 1 只, 无大股东减持标的股票。

图表 11: 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	前涨跌幅(%)
----	------	------	------	--------	------	--------------	---------------	------------	-------	--------	---------

										均价	
1	000690.SZ	宝新能源	2019/5/28	2019/5/27	增持	0.19	0.00		6.87		1.02

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, 中信证券等 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 12: 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	600030.SH	中信证券	2019-05-28	股东大会通过	16.97	定向	20.63	2.79

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 70 只标的股票涉及分红送转事件, 其中有国轩高科、洪涛股份、以岭药业等 4 只股东大会通过, 世荣兆业、上海钢联、安琪酵母等 6 只为实施公告日, 太钢不锈、国金证券、济川药业等 53 只为股权登记日, 深天马 A、冀东水泥、柳工等 7 只为除权除息日。

图表 13: 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	002016.SZ	世荣兆业	2019/5/28	是	0.50	实施公告日	8.73	1.63	5.73	
2	300226.SZ	上海钢联	2019/5/28	是	0.05	实施公告日	69.40	4.72	0.07	
3	600298.SH	安琪酵母	2019/5/28	是	0.35	实施公告日	28.33	2.13	1.24	
4	600633.SH	浙数文化	2019/5/28	是	0.08	实施公告日	9.74	3.07	0.82	
5	600801.SH	华新水泥	2019/5/28	是	1.15	实施公告日	27.74	1.28	4.15	0.40
6	601128.SH	常熟银行	2019/5/28	是	0.18	实施公告日	7.76	0.78	2.32	
7	000825.SZ	太钢不锈	2019/5/31	是	0.10	股权登记日	4.22	1.69	2.37	
8	600109.SH	国金证券	2019/5/31	是	0.04	股权登记日	9.33	3.78	0.43	
9	600566.SH	济川药业	2019/5/31	是	1.23	股权登记日	33.40	2.36	3.68	
10	601988.SH	中国银行	2019/5/31	是	0.18	股权登记日	3.81	0.53	4.83	
11	000099.SZ	中信海直	2019/5/30	是	0.03	股权登记日	7.20	2.27	0.35	
12	000404.SZ	长虹华意	2019/5/30	是	0.02	股权登记日	4.34	2.84	0.46	
13	000543.SZ	皖能电力	2019/5/30	是	0.04	股权登记日	4.65	2.65	0.95	
14	000725.SZ	京东方 A	2019/5/30	是	0.03	股权登记日	3.52	4.14	0.85	
15	000887.SZ	中鼎股份	2019/5/30	是	0.20	股权登记日	9.91	2.16	2.02	
16	002081.SZ	金螳螂	2019/5/30	是	0.20	股权登记日	10.00	1.42	2.00	
17	002092.SZ	中泰化学	2019/5/30	是	0.17	股权登记日	8.11	2.01	2.10	
18	002185.SZ	华天科技	2019/5/30	是	0.02	股权登记日	5.60	7.49	0.36	
19	002223.SZ	鱼跃医疗	2019/5/30	是	0.15	股权登记日	23.62	1.55	0.64	
20	002262.SZ	恩华药业	2019/5/30	是	0.06	股权登记日	11.30	4.63	0.53	
21	002275.SZ	桂林三金	2019/5/30	是	0.35	股权登记日	13.67	2.09	2.56	
22	002465.SZ	海格通信	2019/5/30	是	0.12	股权登记日	9.88	6.01	1.21	
23	002557.SZ	洽洽食品	2019/5/30	是	0.50	股权登记日	21.57	1.27	2.32	

24	300191.SZ	潜能恒信	2019/5/30	是	0.02	股权登记日	17.25	2.50	0.12	
25	300498.SZ	温氏股份	2019/5/30	是	0.50	股权登记日	35.85	6.38	1.39	
26	600019.SH	宝钢股份	2019/5/30	是	0.50	股权登记日	6.75	1.35	7.41	
27	600160.SH	巨化股份	2019/5/30	是	0.15	股权登记日	7.42	3.34	2.02	
28	600449.SH	宁夏建材	2019/5/30	是	0.30	股权登记日	8.55	2.64	3.51	
29	600511.SH	国药股份	2019/5/30	是	0.40	股权登记日	22.82	1.38	1.75	
30	600597.SH	光明乳业	2019/5/30	是	0.10	股权登记日	9.52	1.28	1.05	
31	600720.SH	祁连山	2019/5/30	是	0.30	股权登记日	8.57	2.63	3.45	
32	600893.SH	航发动力	2019/5/30	是	0.14	股权登记日	23.62	1.85	0.60	
33	601633.SH	长城汽车	2019/5/30	是	0.29	股权登记日	8.18	0.49	3.55	
34	000333.SZ	美的集团	2019/5/29	是	1.30	股权登记日	49.75	-0.14	2.62	
35	000565.SZ	渝三峡 A	2019/5/29	是	0.01	股权登记日	5.91	4.60	0.22	
36	000630.SZ	铜陵有色	2019/5/29	是	0.03	股权登记日	2.42	1.68	1.24	
37	002008.SZ	大族激光	2019/5/29	是	0.20	股权登记日	33.31	2.24	0.60	
38	002117.SZ	东港股份	2019/5/29	是	0.70	股权登记日	17.44	3.07	4.01	0.50
39	002221.SZ	东华能源	2019/5/29	是	0.04	股权登记日	8.92	2.76	0.41	
40	002271.SZ	东方雨虹	2019/5/29	是	0.30	股权登记日	20.11	1.00	1.49	
41	002538.SZ	司尔特	2019/5/29	是	0.10	股权登记日	5.55	1.83	1.80	
42	300039.SZ	上海凯宝	2019/5/29	是	0.10	股权登记日	4.51	2.73	2.22	
43	300257.SZ	开山股份	2019/5/29	是	0.10	股权登记日	10.90	2.25	0.92	
44	600261.SH	阳光照明	2019/5/29	是	0.15	股权登记日	3.70	4.82	4.05	
45	600663.SH	陆家嘴	2019/5/29	是	0.50	股权登记日	17.13	1.54	2.91	0.20
46	600704.SH	物产中大	2019/5/29	是	0.25	股权登记日	5.76	1.05	4.34	
47	600771.SH	广誉远	2019/5/29	是		股权登记日	25.56	2.24		0.40
48	000671.SZ	阳光城	2019/5/28	是	0.06	股权登记日	6.31	1.77	0.89	
49	000789.SZ	万年青	2019/5/28	是	0.80	股权登记日	14.28	1.93	5.60	0.30
50	000877.SZ	天山股份	2019/5/28	是	0.38	股权登记日	11.05	2.22	3.44	
51	000937.SZ	冀中能源	2019/5/28	是	0.10	股权登记日	4.00	1.27	2.50	
52	002140.SZ	东华科技	2019/5/28	是	0.10	股权登记日	10.08	0.80	0.99	0.20
53	002151.SZ	北斗星通	2019/5/28	是	0.07	股权登记日	26.00	8.38	0.27	
54	002293.SZ	罗莱生活	2019/5/28	是	0.40	股权登记日	11.08	1.65	3.61	0.10
55	300115.SZ	长盈精密	2019/5/28	是	0.10	股权登记日	10.84	5.34	0.92	
56	600330.SH	天通股份	2019/5/28	是	0.05	股权登记日	7.85	4.95	0.64	
57	600536.SH	中国软件	2019/5/28	是	0.07	股权登记日	64.11	10.00	0.11	
58	600660.SH	福耀玻璃	2019/5/28	是	0.75	股权登记日	22.60	0.49	3.32	
59	601018.SH	宁波港	2019/5/28	是	0.09	股权登记日	4.75	-0.63	1.96	
60	002074.SZ	国轩高科	2019/5/28	是		股东大会通过	13.04	2.68		
61	002325.SZ	洪涛股份	2019/5/28	是		股东大会通过	3.26	2.19		
62	002603.SZ	以岭药业	2019/5/28	是		股东大会通过	11.91	0.93		
63	601166.SH	兴业银行	2019/5/28	是		股东大会通过	18.11	-0.71		
64	000050.SZ	深天马 A	2019/5/28	是	0.07	除权除息日	14.03	4.08	0.50	
65	000401.SZ	冀东水泥	2019/5/28	是	0.40	除权除息日	16.57	2.41	2.41	
66	000528.SZ	柳工	2019/5/28	是	0.15	除权除息日	6.80	2.10	2.21	
67	002493.SZ	荣盛石化	2019/5/28	是	0.10	除权除息日	11.71	2.99	0.85	
68	002563.SZ	森马服饰	2019/5/28	是	0.35	除权除息日	11.20	-1.06	3.13	
69	600048.SH	保利地产	2019/5/28	是	0.50	除权除息日	12.68	0.88	3.94	

70	600971.SH	恒源煤电	2019/5/28	是	0.41	除权除息日	7.56	0.80	5.42	0.20
----	-----------	------	-----------	---	------	-------	------	------	------	------

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 14: 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 个交易日共有领益智造、双良节能、三聚环保等 8 只标的股票涉及限售股解禁。

图表 15: 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	002600.SZ	领益智造	2019/5/28	10297.08	6.35	定向增发机构配售股份	6.49	8.35
2	600481.SH	双良节能	2019/5/29	612.00	0.38	股权激励限售股份	3.83	1.59
3	300072.SZ	三聚环保	2019/5/30	1154.36	0.54	股权激励限售股份	7.84	2.89
4	600728.SH	佳都科技	2019/5/30	200.00	0.12	股权激励限售股份	10.30	3.94
5	600201.SH	生物股份	2019/6/3	81.90	0.07	股权激励限售股份	15.01	-0.27
6	600062.SH	华润双鹤	2019/6/3	21999.55	26.72	定向增发机构配售股份	13.24	1.22
7	002024.SZ	苏宁易购	2019/6/6	192699.65	33.02	定向增发机构配售股份	11.03	2.41
8	002293.SZ	罗莱生活	2019/6/6	101.97	0.13	股权激励限售股份	11.08	1.65

数据来源: Wind、信达证券研发中心

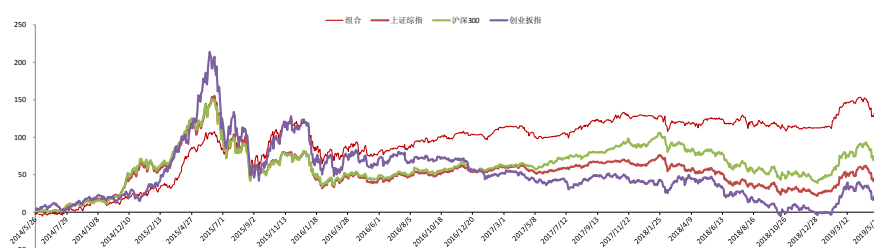
三、事件投资组合操作

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 0.77%, 至 2019 年 5 月 27 日组合累计收益率为 130.46%, 分别超越上证综指、沪深 300 及创业板指 87.37、59.77 及 112.94 个百分点。

图表 16: 组合历史收益曲线



数据来源: Wind、信达证券研发中心

图表 17: 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	0.33	-7.32	0.39	7.93	2.45	8.63
上证综指	0.35	-11.57	4.75	9.08	-10.02	-6.81
沪深 300	-0.32	-11.73	5.37	12.73	-6.89	9.88
创业板指	0.89	-13.05	5.93	9.46	-20.47	-23.96

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 18: 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

今日拟平仓股票有三一重工等 1 只。

图表 19: 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	600031.SH	三一重工	2019/4/15	3.00	-7.33

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 20: 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

昨日平仓股票有徐工机械等 1 只。

图表 21: 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	000425.SZ	徐工机械	2019/04/15	5.12	3.00	4.36	-14.84

数据来源: Wind、信达证券研发中心

4. 组合成分股

至 2019 年 5 月 27 日收盘, 组合共有成分股 5 只, 仓位 15%。

图表 22: 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	600031.SH	三一重工	2019/4/15	13.28	3.00	12.31	-7.33	1.96

2	000415.SZ	渤海租赁	2019/4/16	4.97	3.00	3.94	-20.79	-11.81
3	600655.SH	豫园股份	2019/4/16	9.96	3.00	8.37	-15.98	-6.99
4	002648.SZ	卫星石化	2019/4/18	20.40	3.00	14.50	-28.91	-17.55
5	601628.SH	中国人寿	2019/4/19	31.13	3.00	25.66	-17.57	-6.56

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