

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6月6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 9149.65 亿元(-0.21%), 其中融资余额规模为 9073.39 亿元(-0.24%), 融券余额规模为 76.26 亿元(+4.02%)。从融资规模来看, 上一交易日沪深两市融资买入额为 291.34 亿元(+5.49%), 融资偿还额为 313.26 亿元(+0.23%)。
- 上一交易日, 市场指数中深证成指(-0.03%)表现最好, 创业板指(-0.35%)表现最弱。
- 两融标的股票中, 涨幅前五名为: 综艺股份(+10.06%)、国脉科技(+10.02%)、广电网络(+10.02%)、银泰资源(+9.98%)和敦煌种业(+9.97%); 跌幅前五名为: 天士力(-8.62%)、智飞生物(-7.25%)、上港集团(-7.06%)、恩华药业(-7.02%)和誉衡药业(-6.39%); 五日量比前五名为: 国脉科技(4.64)、天士力(4.26)、纳思达(4.25)、冠城大通(3.8)和恩华药业(3.52)。
- 上一交易日, 发生大宗交易的标的股票有三七互娱、民生银行、冠城大通等 7 只。
- 今日共有 2 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省广集团、比亚迪、中国重工等 3 只, 大股东减持标的股票有鸿达兴业等 4 只。
- 今日披露, 没有标的股票涉及增发事件。
- 今日披露, 共有 94 只标的股票涉及分红送转事件, 其中有粤传媒、中直股份、浙江医药等 8 只股东大会通过, 深圳能源、金科股份、远光软件等 18 只为实施公告日, 中国建筑、仁和药业、华菱钢铁等 47 只为股权登记日, 中航善达、德赛电池、五粮液等 21 只为除权除息日。
- 今日无标的股票业绩报告发布。
- 未来 7 个交易日共有伊利股份、四川长虹、科华生物等 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 0.02%, 至 2019 年 6 月 5 日组合累计收益率为 130.06%, 分别超越上证综指、沪深 300 及创业板指 88.5、61.25 及 115.75 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.....	11
1. 组合历史收益.....	11
2. 今日组合操作.....	11
3. 昨日组合操作回顾.....	12
4. 组合成分股.....	12

图表目录

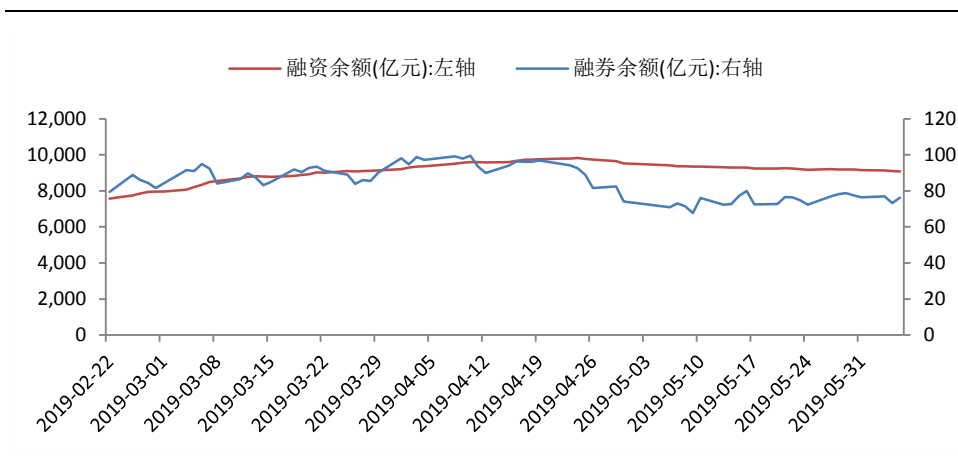
图表 1: 近三月每日融资融券余额规模 (亿元)	3
图表 2: 近三月每日融资买入额及偿还额 (亿元)	3
图表 3: 近期主要市场指数涨跌幅 (%)	4
图表 4: 上一交易日两融标的股票分行业融资余额占流通市值比例及增速 (%)	4
图表 5: 融资融券 ETF 上一交易日涨跌幅 (%)	5
图表 6: 上一交易日涨跌幅排名前 20 标的股票	5
图表 7: 上一交易日五日量比排名前 20 标的股票	6
图表 8: 上一交易日融资余额占流通市值比例及增速排名前 10 标的股票	6
图表 9: 上一交易日发生大宗交易标的股票.....	7
图表 10: 复牌及停牌标的股票.....	7
图表 11: 大股东持股比例变动标的股票.....	7
图表 12: 未来七个交易日标的股票增发.....	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: 未来七个交易日标的股票限售解禁	10
图表 16: 组合历史收益曲线.....	11
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	12
图表 20: 昨日建仓股票	12
图表 21: 昨日平仓股票	12
图表 22: 组合成分股.....	12

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 9149.65 亿元(-0.21%)，其中融资余额规模为 9073.39 亿元(-0.24%)，融券余额规模为 76.26 亿元(+4.02%)。

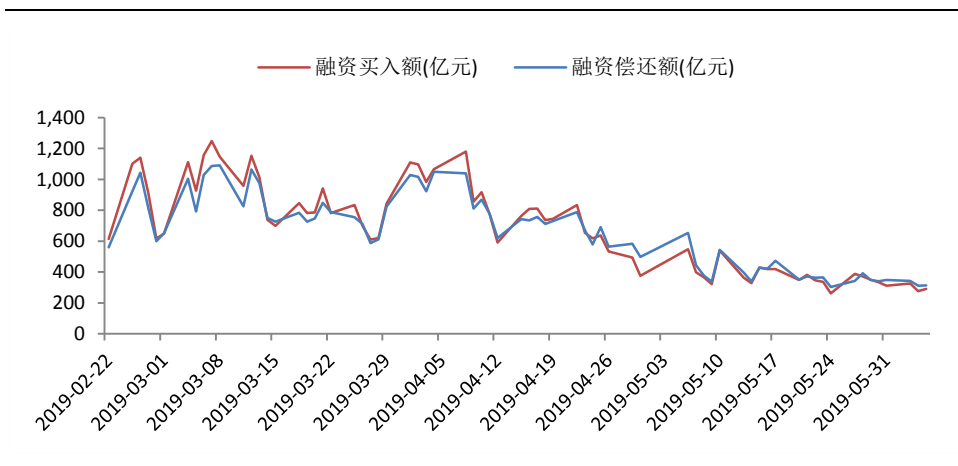
图表 1：近三月每日融资融券余额规模（亿元）



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 291.34 亿元(+5.49%)，融资偿还额为 313.26 亿元(+0.23%)。

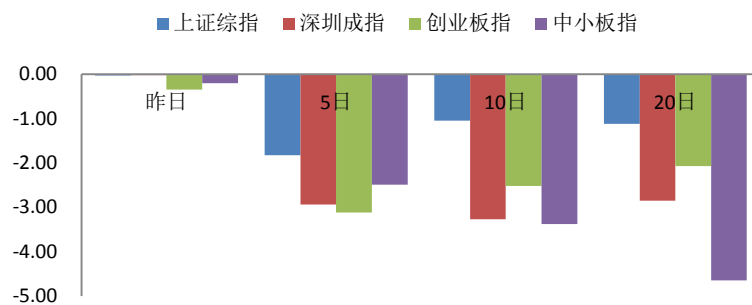
图表 2：近三月每日融资买入额及偿还额（亿元）



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 0.03%，创业板指表现最弱，下跌 0.35%；从 5 日涨跌幅看，上证综指表现较好，下跌 1.83%，创业板指表现最弱，下跌 3.12%；从 10 日涨跌幅看，上证综指表现较好，下跌 1.05%，中小板指表现最弱，下跌 3.37%；从 20 日涨跌幅看，上证综指表现较好，下跌 1.12%，中小板指表现最弱，下跌 4.65%。

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，医药生物(+4.41%)、建筑材料(+3.68%)、休闲服务(+2.85%)等行业增速居前，银行(-1.6%)、房地产(-1.75%)、通信(-2.75%)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（%）

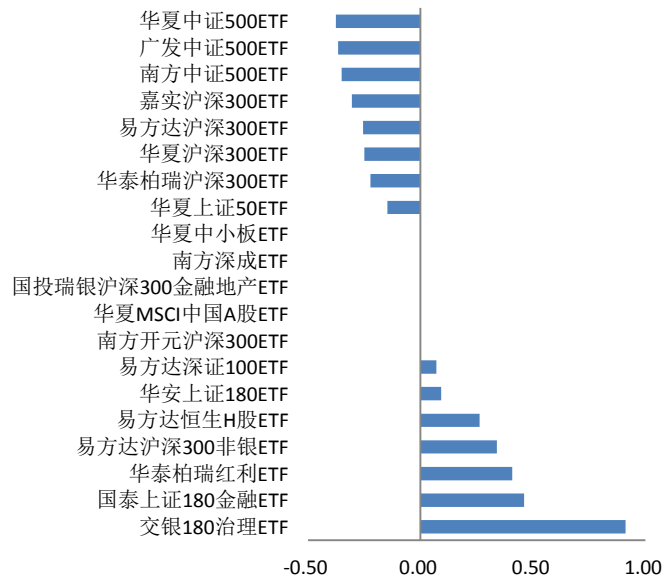
序号	代码	行业	融资余额占流通市值比例(%)	占比增速(%)
1	801150.SI	医药生物	3.19	4.41
2	801710.SI	建筑材料	3.06	3.68
3	801210.SI	休闲服务	0.79	2.85
4	801740.SI	国防军工	4.37	2.00
5	801080.SI	电子	4.94	1.56
6	801120.SI	食品饮料	1.02	1.25
7	801170.SI	交通运输	1.74	1.19
8	801140.SI	轻工制造	6.44	1.18
9	801010.SI	农林牧渔	2.84	1.13
10	801130.SI	纺织服装	2.71	1.00
11	801110.SI	家用电器	1.47	0.65
12	801750.SI	计算机	7.32	0.51
13	801790.SI	非银金融	2.66	0.35
14	801160.SI	公用事业	1.97	0.24
15	801730.SI	电气设备	3.72	0.13
16	801230.SI	综合	6.50	0.05
17	801880.SI	汽车	2.46	-0.08
18	801760.SI	传媒	5.43	-0.17
19	801050.SI	有色金属	5.34	-0.21
20	801040.SI	钢铁	3.08	-0.43
21	801200.SI	商业贸易	4.51	-0.44
22	801030.SI	化工	3.39	-0.71
23	801890.SI	机械设备	3.40	-0.78
24	801020.SI	采掘	0.90	-0.80
25	801720.SI	建筑装饰	2.64	-1.18
26	801780.SI	银行	0.87	-1.60
27	801180.SI	房地产	3.06	-1.75
28	801770.SI	通信	5.83	-2.75

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：交银 180 治理 ETF (+0.91%)、国泰上证 180 金融 ETF (+0.46%) 及华泰柏瑞红利 ETF (+0.41%)；跌幅前三名为：华夏中证 500ETF (-0.38%)、广发中证 500ETF (-0.37%) 及南方中证 500ETF (-0.35%)。

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：综艺股份 (+10.06%)、国脉科技 (+10.02%)、广电网络 (+10.02%)、银泰资源 (+9.98%) 和敦煌种业 (+9.97%)；跌幅前五名为：天士力 (-8.62%)、智飞生物 (-7.25%)、上港集团 (-7.06%)、恩华药业 (-7.02%) 和誉衡药业 (-6.39%)。

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	600770.SH	综艺股份	10.06	1.43	600535.SH	天士力	-8.62	4.26
2	002093.SZ	国脉科技	10.02	4.64	300122.SZ	智飞生物	-7.25	2.91
3	600831.SH	广电网络	10.02	2.00	600018.SH	上港集团	-7.06	2.15
4	000975.SZ	银泰资源	9.98	2.72	002262.SZ	恩华药业	-7.02	3.52
5	600354.SH	敦煌种业	9.97	2.37	002437.SZ	誉衡药业	-6.39	0.79
6	600251.SH	冠农股份	9.95	1.09	000550.SZ	江铃汽车	-6.29	1.23
7	600598.SH	北大荒	9.63	1.41	002180.SZ	纳思达	-6.11	4.25
8	002237.SZ	恒邦股份	8.98	1.75	600867.SH	通化东宝	-5.93	1.55
9	600108.SH	亚盛集团	8.68	2.03	600284.SH	浦东建设	-5.69	1.14
10	000998.SZ	隆平高科	7.64	1.15	600566.SH	济川药业	-5.65	2.61
11	000665.SZ	湖北广电	6.42	2.67	002079.SZ	苏州固锝	-5.04	0.70
12	600222.SH	太龙药业	6.19	2.13	600518.SH	康美药业	-5.03	3.28
13	002556.SZ	辉隆股份	6.07	2.76	600748.SH	上实发展	-4.96	1.69

14	002041.SZ	登海种业	6.02	1.53	600276.SH	恒瑞医药	-4.88	2.38
15	002369.SZ	卓翼科技	5.70	1.89	000966.SZ	长源电力	-4.66	1.07
16	000426.SZ	兴业矿业	5.31	1.69	002007.SZ	华兰生物	-4.62	2.16
17	000671.SZ	阳光城	5.25	2.79	600196.SH	复星医药	-4.60	3.17
18	000063.SZ	中兴通讯	5.21	1.60	000625.SZ	长安汽车	-4.42	2.32
19	600037.SH	歌华有线	5.03	2.41	002191.SZ	劲嘉股份	-4.39	1.20
20	300205.SZ	天喻信息	4.94	1.45	000028.SZ	国药一致	-4.28	2.53

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: 国脉科技 (4.64)、天士力 (4.26)、纳思达 (4.25)、冠城大通 (3.8) 和恩华药业 (3.52)。

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	002093.SZ	国脉科技	10.02	4.64
2	600535.SH	天士力	-8.62	4.26
3	002180.SZ	纳思达	-6.11	4.25
4	600067.SH	冠城大通	3.73	3.80
5	002262.SZ	恩华药业	-7.02	3.52
6	002085.SZ	万丰奥威	4.03	3.32
7	600518.SH	康美药业	-5.03	3.28
8	600196.SH	复星医药	-4.60	3.17
9	600062.SH	华润双鹤	-4.07	2.94
10	300122.SZ	智飞生物	-7.25	2.91
11	600048.SH	保利地产	3.37	2.87
12	600085.SH	同仁堂	-0.11	2.80
13	000671.SZ	阳光城	5.25	2.79
14	002556.SZ	辉隆股份	6.07	2.76
15	000975.SZ	银泰资源	9.98	2.72
16	600056.SH	中国医药	-3.37	2.69
17	000665.SZ	湖北广电	6.42	2.67
18	600187.SH	国中水务	-3.02	2.65
19	600566.SH	济川药业	-5.65	2.61
20	000002.SZ	万科 A	2.78	2.54

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(22.99%)、恒泰艾普(22.53%)、六国化工(19.03%)等, 融资余额占流通市值比例增速前十名是敦煌种业(+30.62%)、长春高新(+28.34%)、紫光国微(+24.62%)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	300273.SZ	和佳股份	22.99	600354.SH	敦煌种业	30.62
2	300157.SZ	恒泰艾普	22.53	000661.SZ	长春高新	28.34
3	600470.SH	六国化工	19.03	002049.SZ	紫光国微	24.62
4	300079.SZ	数码科技	18.92	300065.SZ	海兰信	16.21
5	600218.SH	全柴动力	18.16	600535.SH	天士力	12.82

6	000790.SZ	泰合健康	18.08	601777.SH	力帆股份	11.69
7	002369.SZ	卓翼科技	17.94	000786.SZ	北新建材	11.17
8	600692.SH	亚通股份	17.64	600748.SH	上实发展	10.76
9	000551.SZ	创元科技	17.28	002262.SZ	恩华药业	10.51
10	600668.SH	尖峰集团	17.18	600276.SH	恒瑞医药	10.24

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三七互娱、民生银行、冠城大通等 7 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	002555.SZ	三七互娱	10.74	11.93	-9.97	12.13	205.00	2201.70
2	600016.SH	民生银行	6.18	6.18	0.00	6.19	3245.85	20059.32
3	600067.SH	冠城大通	4.95	4.83	2.48	5.01	3812.25	18870.61
4	600570.SH	恒生电子	60.15	59.33	1.38	60.15	6.50	390.98
5	600919.SH	江苏银行	7.17	7.24	-0.97	7.21	6437.76	46158.77
6	601233.SH	桐昆股份	12.56	12.56	0.00	12.30	2388.53	29999.94
7	601877.SH	正泰电器	23.44	23.44	0.00	23.00	74.00	1734.56

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 2 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 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	600487.SH	亨通光电	停牌	2019-06-03	3	-1.29	拟筹划重大资产重组
2	000062.SZ	深圳华强	停牌	2019-05-28	9	-1.07	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省广集团、比亚迪、中国重工等 3 只, 大股东减持标的股票有鸿达兴业等 4 只。

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(%)	交易均价	变动期间股票均价	前涨跌幅(%)
1	002400.SZ	省广集团	2019/6/6	2019/6/4	增持	1.04	0.00	19.30	3.12	3.16	-0.67
2	002594.SZ	比亚迪	2019/6/6	2019/6/5	增持	0.09	0.00	18.83	48.60	48.61	0.80
3	601989.SH	中国重工	2019/6/6	2019/3/29	增持	0.2766	0.00	35.60	4.24	5.14	
4	002002.SZ	鸿达兴业	2019/6/6	2019/6/4	减持	0.00	0.00	4.13	4.91	4.95	-0.81

5	002002.SZ	鸿达兴业	2019/6/6	2019/5/21	减持	0.3089	0	4.1326	5.4435	5.50934	
6	002002.SZ	鸿达兴业	2019/6/6	2019/5/20	减持	0.1976	0.00	4.44	5.24	5.22	
7	002281.SZ	光迅科技	2019/6/6	2019/6/5	减持	0.0085	0.00	0.03	27.82	28.38	
8	600777.SH	新潮能源	2019/6/6	2019/5/31	减持	0.2295	0	5.4828		2.1534	
9	600777.SH	新潮能源	2019/6/6	2019/5/30	减持	0.23	0.00	5.62		2.15	-0.97
10	601985.SH	中国核电	2019/6/6	2019/1/25	减持	0.00	0.00			5.30	0.37
11	601985.SH	中国核电	2019/6/6	2018/12/25	减持		0.00			5.26	0.37

数据来源: Wind、信达证券研发中心

3. 标的股票增发

今日披露, 没有标的股票涉及增发事件。

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								

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 94 只标的股票涉及分红送转事件, 其中有粤传媒、中直股份、浙江医药等 8 只股东大会通过, 深圳能源、金科股份、远光软件等 18 只为实施公告日, 中国建筑、仁和药业、华菱钢铁等 47 只为股权登记日, 中航善达、德赛电池、五粮液等 21 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	000027.SZ	深圳能源	2019/6/6	是	0.05	实施公告日	5.91	0.34	0.85	
2	000656.SZ	金科股份	2019/6/6	是	0.36	实施公告日	6.32	0.96	5.70	
3	002063.SZ	远光软件	2019/6/6	是	0.05	实施公告日	8.25	4.17	0.61	
4	002229.SZ	鸿博股份	2019/6/6	是	0.03	实施公告日	8.04	2.55	0.37	
5	002241.SZ	歌尔股份	2019/6/6	是	0.10	实施公告日	8.02	1.39	1.25	
6	300065.SZ	海兰信	2019/6/6	是	0.03	实施公告日	11.78	-2.89	0.25	
7	600056.SH	中国医药	2019/6/6	是	0.43	实施公告日	13.21	-3.37	3.28	
8	600138.SH	中青旅	2019/6/6	是	0.14	实施公告日	12.59	0.40	1.11	
9	600220.SH	江苏阳光	2019/6/6	是	0.03	实施公告日	2.53	0.40	1.19	
10	600337.SH	美克家居	2019/6/6	是	0.20	实施公告日	4.72	0.00	4.24	
11	600389.SH	江山股份	2019/6/6	是	0.40	实施公告日	20.51	-1.82	1.95	
12	600426.SH	华鲁恒升	2019/6/6	是	0.20	实施公告日	13.62	-0.87	1.47	
13	600535.SH	天士力	2019/6/6	是	0.30	实施公告日	16.21	-8.62	1.85	
14	600563.SH	法拉电子	2019/6/6	是	1.30	实施公告日	42.32	-0.14	3.07	
15	600787.SH	中储股份	2019/6/6	是	0.02	实施公告日	5.39	-0.19	0.43	
16	600830.SH	香溢融通	2019/6/6	是	0.06	实施公告日	5.92	-0.34	1.01	
17	601126.SH	四方股份	2019/6/6	是	0.18	实施公告日	5.73	0.70	3.11	
18	601388.SH	怡球资源	2019/6/6	是	0.01	实施公告日	1.95	-1.02	0.51	
19	601668.SH	中国建筑	2019/6/13	是	0.17	股权登记日	5.66	1.25	2.97	
20	000650.SZ	仁和药业	2019/6/12	是	0.10	股权登记日	7.71	-0.52	1.30	
21	000932.SZ	华菱钢铁	2019/6/12	是		股权登记日	6.28	0.16		0.40

22	002353.SZ	杰瑞股份	2019/6/12	是	0.12	股权登记日	21.04	0.67	0.57	
23	002393.SZ	力生制药	2019/6/12	是	0.30	股权登记日	23.64	0.13	1.27	
24	002424.SZ	贵州百灵	2019/6/12	是	0.08	股权登记日	10.40	-1.05	0.77	
25	600021.SH	上海电力	2019/6/12	是	0.33	股权登记日	8.45	0.36	3.91	
26	600094.SH	大名城	2019/6/12	是	0.02	股权登记日	7.52	1.21	0.27	
27	600269.SH	赣粤高速	2019/6/12	是	0.10	股权登记日	4.46	0.45	2.24	
28	600456.SH	宝钛股份	2019/6/12	是	0.10	股权登记日	21.37	2.69	0.47	
29	600565.SH	迪马股份	2019/6/12	是	0.28	股权登记日	3.93	3.42	7.12	
30	600596.SH	新安股份	2019/6/12	是	0.53	股权登记日	11.10	0.73	4.77	
31	600831.SH	广电网络	2019/6/12	是	0.01	股权登记日	12.85	10.02	0.08	
32	600970.SH	中材国际	2019/6/12	是	0.27	股权登记日	6.44	-0.16	4.11	
33	000402.SZ	金融街	2019/6/11	是	0.30	股权登记日	7.37	1.38	4.07	
34	000552.SZ	靖远煤电	2019/6/11	是	0.10	股权登记日	2.75	0.00	3.64	
35	000900.SZ	现代投资	2019/6/11	是	0.15	股权登记日	4.72	0.64	3.18	
36	000928.SZ	中钢国际	2019/6/11	是	0.12	股权登记日	5.55	0.54	2.16	
37	002085.SZ	万丰奥威	2019/6/11	是	0.30	股权登记日	7.49	4.03	4.05	
38	002148.SZ	北纬科技	2019/6/11	是	0.03	股权登记日	6.73	2.44	0.37	
39	002203.SZ	海亮股份	2019/6/11	是	0.07	股权登记日	11.62	4.22	0.61	
40	002588.SZ	史丹利	2019/6/11	是	0.02	股权登记日	4.66	0.00	0.43	
41	002736.SZ	国信证券	2019/6/11	是	0.12	股权登记日	11.94	1.27	1.01	
42	300205.SZ	天喻信息	2019/6/11	是	0.10	股权登记日	15.08	4.94	0.66	
43	600059.SH	古越龙山	2019/6/11	是	0.10	股权登记日	9.20	0.00	1.09	
44	600120.SH	浙江东方	2019/6/11	是	0.10	股权登记日	16.61	1.34	0.60	0.30
45	600251.SH	冠农股份	2019/6/11	是	0.01	股权登记日	6.52	9.95	0.20	
46	600285.SH	羚锐制药	2019/6/11	是	0.15	股权登记日	8.12	-2.75	1.85	
47	600382.SH	广东明珠	2019/6/11	是	0.06	股权登记日	10.37	0.10	0.58	0.30
48	600409.SH	三友化工	2019/6/11	是	0.23	股权登记日	5.73	0.53	4.03	
49	600750.SH	江中药业	2019/6/11	是	0.35	股权登记日	16.26	-0.73	2.15	0.25
50	603323.SH	苏农银行	2019/6/11	是	0.10	股权登记日	6.02	0.17	1.66	0.10
51	000703.SZ	恒逸石化	2019/6/10	是	0.30	股权登记日	12.88	0.39	2.33	
52	000989.SZ	九芝堂	2019/6/10	是	0.40	股权登记日	8.90	-0.56	4.49	
53	002195.SZ	二三四五	2019/6/10	是	0.03	股权登记日	4.93	0.00	0.61	0.30
54	002368.SZ	太极股份	2019/6/10	是	0.23	股权登记日	30.73	-0.16	0.75	
55	600000.SH	浦发银行	2019/6/10	是	0.35	股权登记日	11.41	0.53	3.07	
56	600028.SH	中国石化	2019/6/10	是	0.26	股权登记日	5.48	0.92	4.74	
57	600188.SH	兖州煤业	2019/6/10	是	0.54	股权登记日	10.57	0.76	5.11	
58	600487.SH	亨通光电	2019/6/10	是	0.15	股权登记日	15.85	0.00	0.95	
59	600502.SH	安徽水利	2019/6/10	是	0.15	股权登记日	4.76	-0.83	3.15	
60	600729.SH	重庆百货	2019/6/10	是	0.65	股权登记日	29.98	2.25	2.17	
61	002028.SZ	思源电气	2019/6/6	是	0.10	股权登记日	10.10	1.20	0.99	
62	600711.SH	盛屯矿业	2019/6/6	是	0.02	股权登记日	5.10	0.20	0.45	
63	600894.SH	广日股份	2019/6/6	是	0.05	股权登记日	6.86	-0.15	0.73	
64	601012.SH	隆基股份	2019/6/6	是	0.10	股权登记日	23.01	-1.33	0.43	
65	601881.SH	中国银河	2019/6/6	是	0.09	股权登记日	10.15	0.50	0.89	
66	002181.SZ	粤传媒	2019/6/6	是		股东大会通过	4.67	-1.06		
67	600038.SH	中直股份	2019/6/6	是		股东大会通过	39.18	-0.76		

68	600216.SH	浙江医药	2019/6/6	是		股东大会通过	10.38	0.68		
69	600648.SH	外高桥	2019/6/6	是		股东大会通过	20.12	-1.81		
70	600662.SH	强生控股	2019/6/6	是		股东大会通过	5.20	0.19		
71	600776.SH	东方通信	2019/6/6	是		股东大会通过	23.47	-1.47		
72	601107.SH	四川成渝	2019/6/6	是		股东大会通过	4.09	0.25		
73	601601.SH	中国太保	2019/6/6	是		股东大会通过	33.83	-1.43		
74	000043.SZ	中航善达	2019/6/6	是	0.30	除权除息日	10.80	0.09	2.78	
75	000049.SZ	德赛电池	2019/6/6	是	0.25	除权除息日	24.61	-1.95	1.02	
76	000858.SZ	五粮液	2019/6/6	是	1.70	除权除息日	99.05	-0.14	1.72	
77	002002.SZ	鸿达兴业	2019/6/6	是	0.06	除权除息日	4.89	-0.81	1.23	
78	002106.SZ	莱宝高科	2019/6/6	是	0.10	除权除息日	7.16	-0.14	1.40	
79	002108.SZ	沧州明珠	2019/6/6	是	0.10	除权除息日	4.18	0.00	2.39	
80	002302.SZ	西部建设	2019/6/6	是	0.07	除权除息日	10.58	-0.56	0.66	
81	002372.SZ	伟星新材	2019/6/6	是	0.60	除权除息日	18.91	0.05	3.17	0.20
82	002439.SZ	启明星辰	2019/6/6	是	0.04	除权除息日	24.04	0.67	0.17	
83	002440.SZ	闰土股份	2019/6/6	是	0.50	除权除息日	12.68	-1.25	3.94	
84	300053.SZ	欧比特	2019/6/6	是	0.02	除权除息日	11.34	0.89	0.18	
85	300251.SZ	光线传媒	2019/6/6	是	0.05	除权除息日	6.73	0.60	0.74	
86	600073.SH	上海梅林	2019/6/6	是	0.10	除权除息日	9.43	0.75	1.06	
87	600183.SH	生益科技	2019/6/6	是	0.35	除权除息日	14.22	-2.00	2.46	
88	600256.SH	广汇能源	2019/6/6	是	0.10	除权除息日	3.63	-0.55	2.75	
89	600352.SH	浙江龙盛	2019/6/6	是	0.25	除权除息日	16.00	-3.38	1.56	
90	600495.SH	晋西车轴	2019/6/6	是	0.01	除权除息日	4.47	0.00	0.27	
91	600548.SH	深高速	2019/6/6	是	0.71	除权除息日	10.58	2.03	6.71	
92	600559.SH	老白干酒	2019/6/6	是	0.20	除权除息日	15.19	0.60	1.32	0.30
93	600976.SH	健民集团	2019/6/6	是	0.20	除权除息日	16.45	0.30	1.22	
94	601158.SH	重庆水务	2019/6/6	是	0.28	除权除息日	5.85	-0.34	4.79	

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 个交易日共有伊利股份、四川长虹、科华生物等 10 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	600887.SH	伊利股份	2019/6/6	46.88	0.01	股权激励一般股份	30.12	-0.56
2	600839.SH	四川长虹	2019/6/6	3.16	0.00	股权分置限售股份	3.02	0.00
3	002022.SZ	科华生物	2019/6/6	20.61	0.04	股权激励限售股份	9.94	0.00

4	002024.SZ	苏宁易购	2019/6/6	192699.65	33.37	定向增发机构配售股份	10.89	1.30
5	002293.SZ	罗莱生活	2019/6/6	101.97	0.13	股权激励限售股份	9.92	1.12
6	002151.SZ	北斗星通	2019/6/6	400.76	1.35	定向增发机构配售股份	24.03	-0.58
7	600175.SH	美都能源	2019/6/10	112545.13	45.92	定向增发机构配售股份	2.52	0.00
8	601138.SH	工业富联	2019/6/10	49088.23	43.91	首发机构配售股份,首发战 略配售股份	13.08	0.00
9	601233.SH	桐昆股份	2019/6/10	3756.71	2.11	定向增发机构配售股份	12.30	-2.07
10	600827.SH	百联股份	2019/6/14	6167.24	4.00	定向增发机构配售股份	9.29	0.32

数据来源: Wind、信达证券研发中心

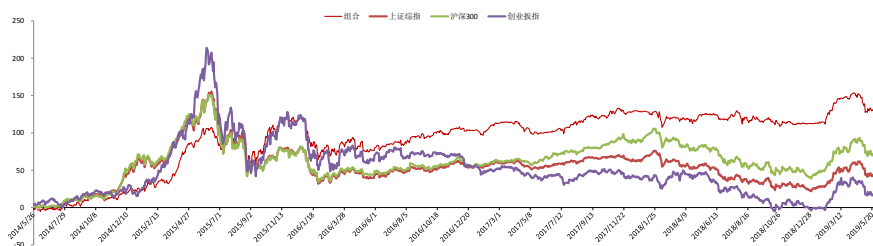
三、事件投资组合操作

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 6 月 5 日组合累计收益率为 130.06%, 分别超越上证综指、沪深 300 及创业板指 88.5、61.25 及 115.75 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	-0.25	1.12	-5.18	8.32	2.53	8.44
上证综指	-1.67	-7.05	-4.43	10.56	-7.56	-7.80
沪深 300	-2.05	-8.08	-4.07	13.38	-5.40	8.67
创业板指	-3.59	-10.63	-7.44	9.16	-16.78	-26.04

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

今日无拟平仓股票。

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					

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

昨日无平仓股票。

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							

数据来源: Wind、信达证券研发中心

4. 组合成分股

至 2019 年 6 月 5 日收盘, 组合共有成分股 2 只, 仓位 6%。

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	000001.SZ	平安银行	2019/5/31	12.22	3.00	11.97	-2.06	-0.53
2	601566.SH	九牧王	2019/5/31	13.48	3.00	12.46	-7.56	-6.03

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