



## 定增量化投资组合

|         |                |
|---------|----------------|
| 投资顾问：   | 胡宇             |
| 执业证书编号： | S1280611120001 |

【本周调入】：无。

【本周调出】：无。

### 【重要声明】

本投资建议中的信息均来源于已公开的资料，我对这些信息的准确性及完整性不作任何保证，不保证该信息未经任何更新，也不保证本公司作出的任何建议不会发生任何变更。在任何情况下，投资建议中的信息或所表达的意见并不构成所述证券买卖的出价或询价。在任何情况下，我公司不就本投资建议中的任何内容对任何投资作出任何形式的担保。我公司及其关联机构可能会持有投资建议中提到的公司所发行的证券并进行交易，还可能为这些公司提供或争取提供投资银行或财务顾问服务。我公司的关联机构或个人可能在本投资建议公开前已经使用或了解其中的信息。本投资建议版权归华林证券有限责任公司所有。未获得华林证券有限责任公司事先书面授权，任何人不得对本投资建议进行任何形式的发布、复制，且不得对本投资建议进行有悖原意的删节和修改。投资者因依赖本投资建议进行投资决策而导致的财产损失，我公司不承担法律责任。

### 【投资组合简况】

| 代码 | 简称 | 调入价 | 最新价 | 调入日期 | 调入至今<br>涨幅 | 仓位占比 |
|----|----|-----|-----|------|------------|------|
|    |    |     |     |      |            |      |

资料来源：华林证券财富管理中心、wind



## 1. 【组合回顾及本期操作】

本周投资组合中，无调出，根据规则已调出组合个股表现如下：

| 代码        | 简称   | 调入日期     | 调入价   | 调出价   | 调出日期     | 收益率（%） |
|-----------|------|----------|-------|-------|----------|--------|
| 000728.SZ | 国元证券 | 20150827 | 15.80 | 16.90 | 20160114 | 6.96%  |
| 002739.SZ | 万达院线 | 20151118 | 99.69 | 95.98 | 20160121 | -3.72% |

## 2. 【投资组合概况】

初始金额：1000.00万元

量化定增组合净值：

### 【产品说明】

本产品以定向增发为切入点，通过方案分析、评级、行业发展及市场热点等因素的变化，结合近期股价走势，挖掘被市场低估的投资品种，构建未来价格有望持续走高的低风险品种股票组合，组合内所有品种均有研究报告及行业数据支持，以体现正确的价值投资理念。

产品类型：高风险类型。 客户适用性：激进型客户。

### 【更新频率】

股票池每周调整更新一次

**调入规则：**股价位于定向增发价之下或附近、定增方案至少通过股东大会审核、同期净资产收益率为正、研究员关注度高、业绩增长稳定。

**调出规则：**研究员认为其基本面、技术面等发生有损于股价的变化时，建议调出股票池。

股票自调入之日起超额收益率超过10%时调出股票池。

非除权因素的定增价格下调时调出股票池。

调入股票跌幅20%以上时止损调出股票池。

**风险提示：**本产品来源于公开信息，不做具体投资建议，务请阅读首页中的重要申明。

**资质申明：**中国证监会核准华林证券有限责任公司证券投资咨询业务资格

**作者申明：**作者具有中国证券业协会授予的证券投资咨询执业资格并注册为证券投资顾问，保证报告所采用的数据均来自合规渠道，分析逻辑基于作者的职业理解，报告清晰准确的反映了作者的研究观点，力求独立、公正及客观，结论不受任何第三方的授意或影响，特此申明。



**免责声明：**本报告专供华林证券有限责任公司证券投资顾问使用，作为其向客户提供证券投资顾问服务的依据之一，报告不构成对任何投资者的投资建议，也不同于本公司发布的“证券研究报告”。

**版权申明：**本报告版权仅为本公司所有，未经书面许可，任何机构及个人不得以任何形式翻版、复制、发表或引用。

**风险提示：**

市场有风险，投资需谨慎。本公司证券投资顾问可能根据本报告作出投资建议，投资者应当充分了解证券投资顾问业务中的风险：

投资者接受证券投资顾问服务后需自主作出投资决策并独立承担投资风险。

本公司及其证券投资顾问提供的服务不能确保投资者获得盈利或本金不受损失。

本公司及其证券投资顾问提供的投资建议具有针对性和时效性，不能在任何市场环境下长期有效。

本报告作为投资建议依据时，可能存在不准确、不全面或者被误读的风险。

本公司及其证券投资顾问可能存在道德风险，如投资者发现投资顾问存在违法违规行为或利益冲突情形，如泄露客户投资决策计划、传播虚假信息、进行关联交易等，投资者可以像本公司投诉或向有关部门举报。

上述风险揭示仅为列举性质，未能详尽列明投资者接受证券投资顾问服务所面临的全部风险和可能导致投资者投资损失的所有因素。

## 华林证券财富管理中心

地址：深圳福田区民田路178号华融大厦5楼

邮编：518048

客服电话：400-188-3888

公司网址：[www.chinalions.cn](http://www.chinalions.cn)