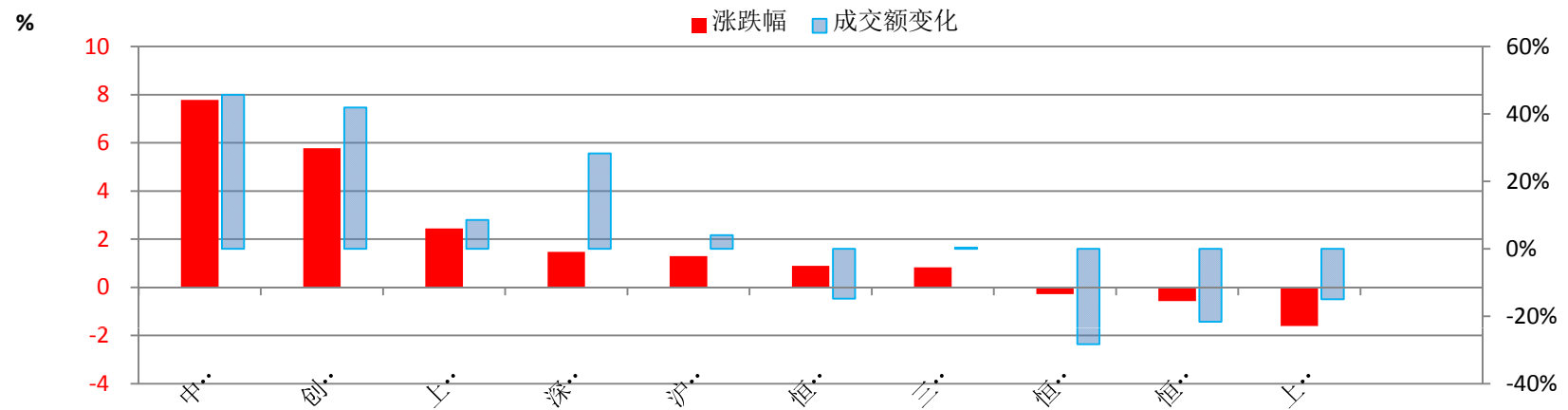


沃胜资产管理

20150518
周报概览

1.1 市场表现：沪深、香港指数表现

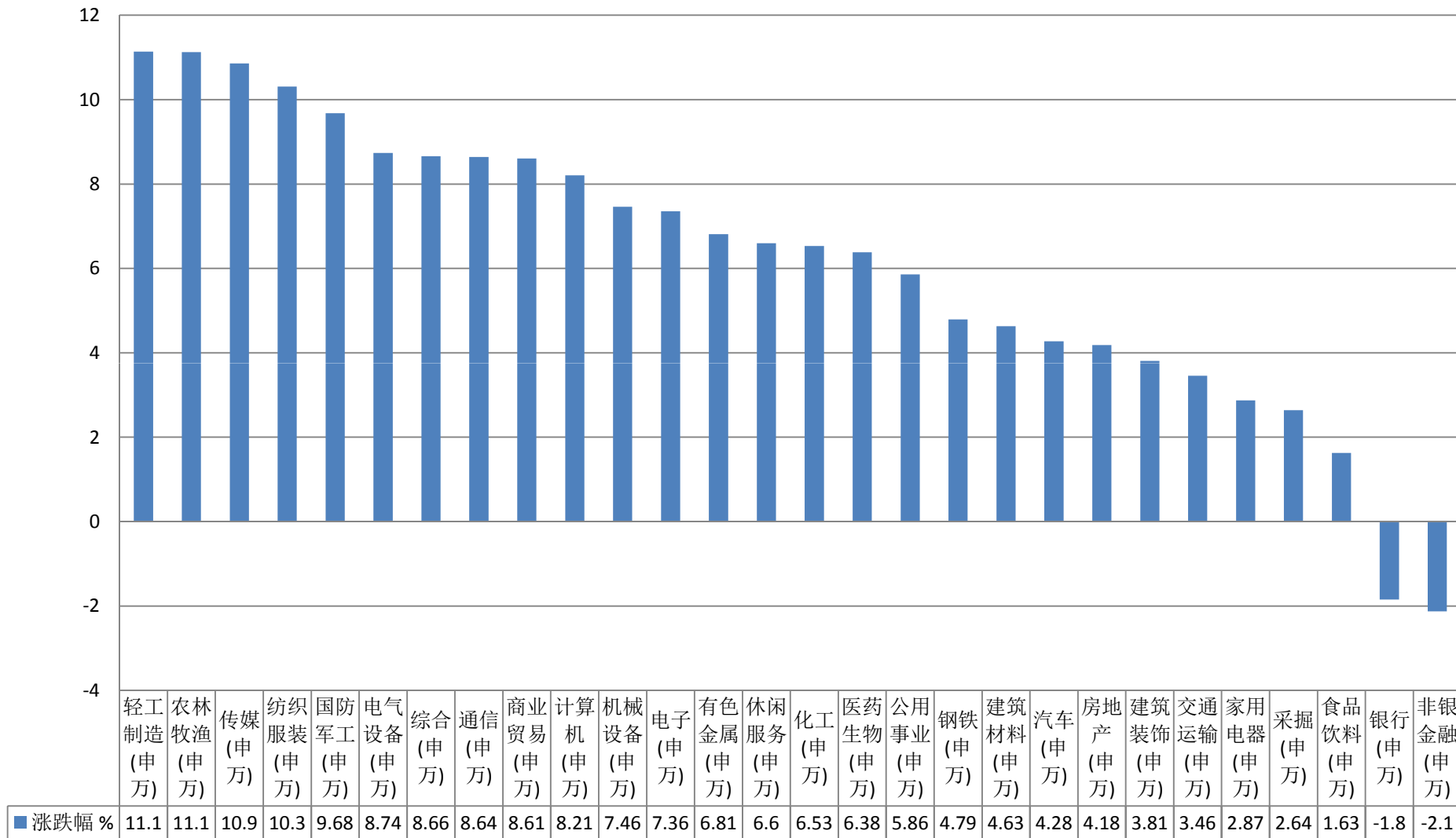
- 沪深两市：放量上涨
- 创业板指：放量上涨；中小板指：放量上涨
- 香港：缩量上涨



板块	中小板指	创业板指	上证综指	深证成指	沪深300	恒生指数	三板成指	恒生国企指数	恒生红筹指数	上证50
涨跌幅(%)	7.78	5.78	2.44	1.48	1.30	0.89	0.83	-0.28	-0.58	-1.61
成交量变动	45.69%	41.92%	8.56%	28.26%	4.09%	-14.77%	0.35%	-28.35%	-21.63%	-14.96%
今年以来涨跌幅(%)	76.39	113.71	33.20	33.41	30.67	17.87	71.17	16.90	22.89	18.55

1.2 市场表现：板块涨跌幅

申银板块涨跌幅



个股涨跌幅前二十位两周间比较

上一周涨幅前三十六位的股票行业中计算机，机械设备居多；跌幅前20的股票行业中计算机，房地产居多。再前一周涨幅前二十位的股票行业中计算机，机械设备居多；跌幅前20的股票行业中交通运输，房地产居多。

涨幅(%) 前36位			
证券代码	证券简称	周涨跌幅 %	申万行业
000005. SZ	世纪星源	61.2195	房地产
600503. SH	华丽家族	61.1738	房地产
002119. SZ	康强电子	61.1411	电子
002421. SZ	达实智能	61.1338	计算机
600959. SH	江苏有线	61.1328	传媒
000883. SZ	湖北能源	61.1198	公用事业
300404. SZ	博济医药	61.1035	医药生物
002752. SZ	昇兴股份	61.1017	轻工制造
300001. SZ	特锐德	61.0940	电气设备
002751. SZ	易尚展示	61.0846	轻工制造
300444. SZ	双杰电气	61.0841	电气设备
603703. SH	盛洋科技	61.0806	通信
002131. SZ	利欧股份	61.0771	机械设备
601608. SH	中信重工	61.0755	机械设备
300434. SZ	金石东方	61.0755	机械设备
002491. SZ	通鼎互联	61.0740	通信
600179. SH	黑化股份	61.0714	采掘
300448. SZ	浩云科技	61.0707	计算机
603789. SH	星光农机	61.0700	机械设备
300437. SZ	清水源	61.0673	化工

涨幅(%) 前36位			
证券代码	证券简称	周涨跌幅 %	申万行业
603318. SH	派思股份	61.0659	机械设备
300445. SZ	康斯特	61.0632	机械设备
300424. SZ	航新科技	61.0625	国防军工
300436. SZ	广生堂	61.0563	医药生物
002171. SZ	精诚铜业	61.0559	有色金属
002555. SZ	顺荣三七	61.0523	传媒
300348. SZ	长亮科技	61.0516	计算机
300449. SZ	汉邦高科	61.0502	计算机
300439. SZ	美康生物	61.0477	医药生物
300447. SZ	全信股份	61.0473	电气设备
300446. SZ	乐凯新材	61.0472	电子
603021. SH	山东华鹏	61.0428	轻工制造
300186. SZ	大华农	61.0420	农林牧渔
300438. SZ	鹏辉能源	61.0418	电子
300441. SZ	鲍斯股份	61.0262	机械设备
300442. SZ	普丽盛	61.0030	机械设备

个股涨跌幅前二十位两周间比较

上一周涨幅前二十位的股票行业中计算机，机械设备居多；跌幅前20的股票行业中计算机，房地产居多。再前一周涨幅前二十位的股票行业中计算机，机械设备居多；跌幅前20的股票行业中交通运输，房地产居多。

涨幅(%) 前20位			
证券代码	证券简称	周涨跌幅 %	申万行业

跌幅(%) 前20位			
证券代码	证券简称	周涨跌幅 %	申万行业
002633. SZ	*ST申科	-14.4670	机械设备
300377. SZ	赢时胜	-11.6662	计算机
000912. SZ	*ST天化	-10.5485	化工
000829. SZ	天音控股	-10.2780	商业贸易
300149. SZ	量子高科	-10.0498	农林牧渔
600665. SH	天地源	-8.6917	房地产
002363. SZ	隆基机械	-8.6369	汽车
000972. SZ	新中基	-8.1433	农林牧渔
600048. SH	保利地产	-7.8248	房地产
600536. SH	中国软件	-7.4239	计算机
300363. SZ	博腾股份	-6.9213	医药生物
300264. SZ	佳创视讯	-6.4516	计算机
300253. SZ	卫宁软件	-6.4005	计算机
300171. SZ	东富龙	-6.2844	医药生物
600715. SH	*ST松辽	-6.2739	汽车
600724. SH	宁波富达	-6.0570	房地产
000728. SZ	国元证券	-5.9610	非银金融
000625. SZ	长安汽车	-5.8629	汽车
300373. SZ	扬杰科技	-5.8019	电子
300058. SZ	蓝色光标	-5.8017	传媒

2.1 信托公布净值

- 沃胜一期5月8日信托公布净值为246.98，今年以来增长率50.94%。
- 沃胜二期5月8日信托公布净值为148.53（累计净值197.56），今年以来增长率69.05%。
- 沃胜三期5月8日信托公布净值为154.92，今年以来增长率51.94%。
- 沃胜五期5月8日信托公布净值为172.02，今年以来增长率46.26%。
- 沃胜六期5月8日信托公布净值为168.01，今年以来增长率42.83%。

2.2 私募排排网：沃胜一期



最新私募排排网上今年以来(2015-04)策略排名：324/1522.

2.2 私募排排网：沃胜二期



•最新私募排排网上今年以来(2015-04)策略排名：136/1522.

2.2 私募排排网：沃胜三期



最新私募排排网上今年以来(2015-03)策略排名：365/1522.

2.2 私募排排网：沃胜五期



最新私募排排网上今年以来(2015-04)策略排名：434/1522.

3.1 沪深300成分股调整



中证指数公司每年6月和12月对沪深300成分股进行调整。基于历史，预测调入股票将会取得超额收益。

年份	超额回报（基于沪深300）%	股票只数	胜率 %
2007	6.95	27	55.56
2008	2.87	19	63.16
2009	-3.10	23	34.78
2010	5.05	17	64.71
2011	7.12	23	91.3
2012	7.77	18	66.67
2013	7.24	15	53.33
2014	6.08	26	65.38
综合表现	4.92	168	61.90

数据来源：国泰君安

3.2 沪深300成分股调整

今年预测调入股票列表：

国信证券，大唐发电，万达院线，光大证券，中国远洋，**乐视网**，泛海控股，海南矿业，春秋航空，太平洋，武钢股份，**东方财富**，营口港，粤电力A，中国一重，中海发展，神州泰岳，振华重工，天津港。

今年预测调出股票列表：

冀东水泥，华映科技，云南铜业，省广股份，爱施德，兆驰股份，五矿发展，人福医药，亚盛集团，金发科技，海正药业，盘江股份，片仔癀，烽火通信，豫园商城，哈药股份，山西汾酒，博瑞传播，纽威股份。

建议交易策略：

由于指数基金，投机者会参与成分股调整，建议现在买入预测中的调入股票，同时用股指期货对冲至六月指数成分股调整日。

近期利空信号：

1. 中央汇金四月（17日和22日）大幅减持四大蓝筹风格ETF： 华安上证180 ETF， 华夏上证50 ETF， 华夏沪深300 ETF， 华泰柏瑞沪深300 ETF。预计抛售规模合计超过200亿元！
2. 上周四的创业板龙头集体跌停，创业板周五虽然止跌企稳，但前20龙头股中有11只下跌，2只停牌，7只上涨。短期风险犹存。
3. 本周20只新股上市或冻结3万亿。
4. 近期官媒口风出现变化，不断提示当前风险（《人民日报：别对监管部门喊话不以为然》）；证监会直接提示炒股风险。

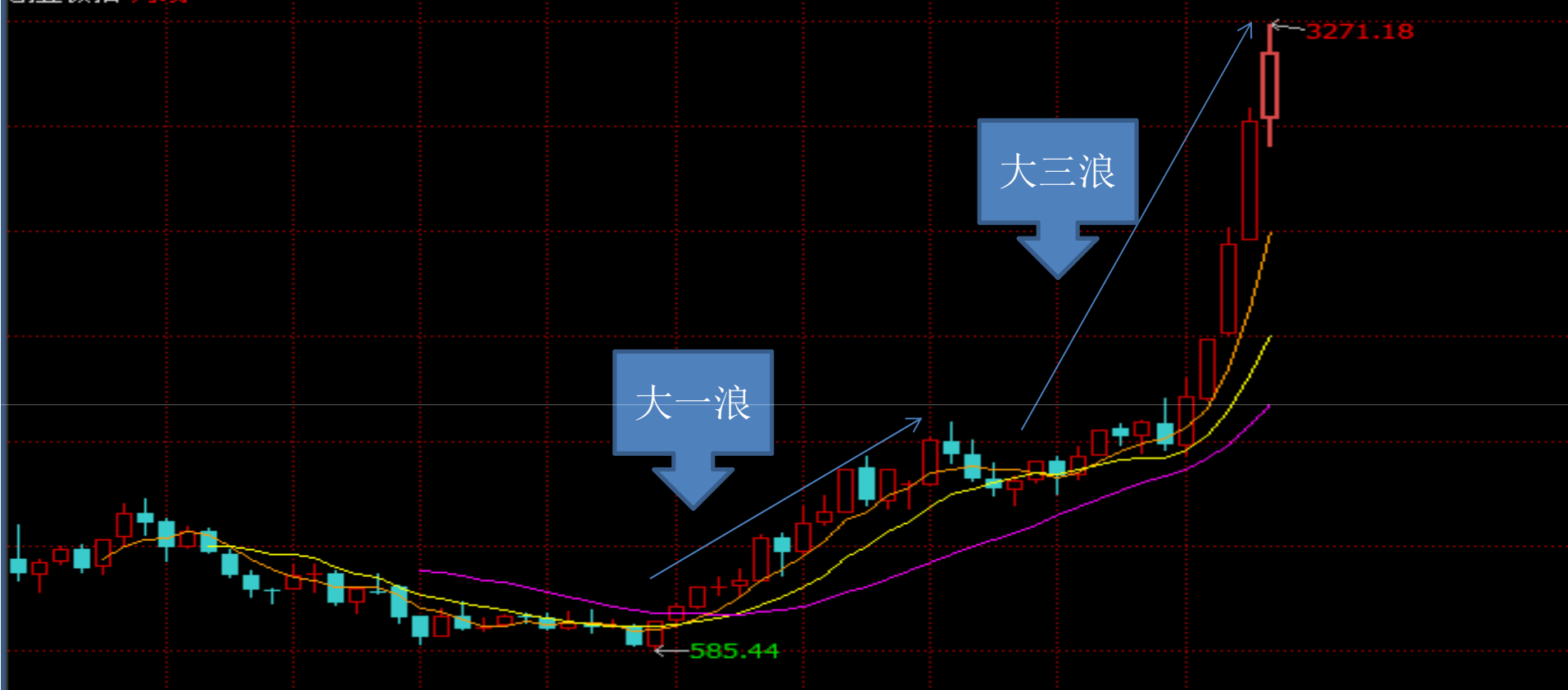
近期利好信号：

1. 总理对于电子商务的力挺，《国务院关于大力发展电子商务加快培育经济新动力的意见》出台。
2. 银行存贷比今后将变为参考指标，预计可以释放数万亿元信贷资金。
3. 财政部、中国人民银行、银监会联合发文，规定采用定向承销方式发行地方债，而地方债将纳入抵押品框架。有利于短期经济增长的稳定，增加降准概率。
4. 公立医院改革试点意见印发 医药股望迎来蜜月期。
5. 国务院取消第三类医疗技术临床应用准入审批，基因测序，细胞治疗或将迎来利好。

3.4 月线信号

2015/05/15 收 3145.34 幅 10.06%(287.45) 开 2868.10 高 3271.18 低 2753.87 振 18.10% 额 7088.84亿

创业板指 月线 MA5:2389.404 MA10:1946.824 MA20:1649.216



大一浪：14个月；大三浪：已经13个月

大一浪：上涨910（585-1495）；大三浪：一浪的1.618-2.618倍，即2755-3630

理论上分析：无论是上涨时间还是上涨空间都还未结束（注：除2014年之外，创业板历史上每年6月收低）

谢 谢