

# 两市全天走出“倒U型”趋势 券业加速数字化进程

## 证券研究报告—行业日报

2023. 06. 01

（预计发布时间：2023. 06. 01）

分析师：闫晓伟

执业证书编号：S0770519080001

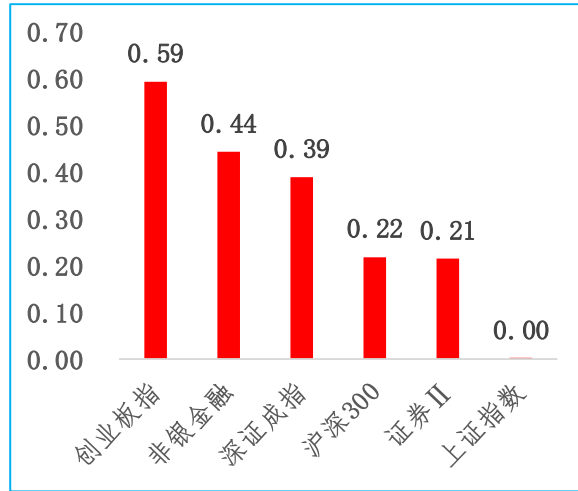
电话：18535125736

E-mail：yanxw@dtsec.com.cn

地址：山西太原长治路 111 号山西世贸中心 A 座  
F12、F13

网址：<http://www.dtsbc.com.cn>

06 月 01 日主要指数表现 (%)



数据来源：同花顺 iFinD 大同证券研究发展部

### 核心观点

周四（6月1日），三大指数早盘低开，之后震荡走高，悉数翻红。午盘冲高回落，震荡下行，沪指尾盘小幅翻绿后收平，再守 3200 点；深指、创业板指涨幅收窄，小幅收红，两市全天走出“倒U型”走势。

近期，经济数据表现大多不及预期，两市受宏观经济预期下降影响，持续走弱。叠加人民币的持续贬值，市场短期内虽已度过恐慌期，但场内投资者信心仍未树立。

短期内，市场情绪面持续低迷，上行动力仍然较低。但随着利空因素的逐步消化，叠加沪指 3200 点位强支撑力下，行情进一步回调的可能性较小。

就券商板块来说，近期板块内部并无较大利好消息，板块更多的是跟随市场变动。但中长期来看，随着券业数字化转型的逐步发力，券商板块业务或有望在数字化的支持下，探寻出创新性业务发展方向，助力券业再度打开发展空间，推动板块上行。

**风险提示：**短期突发利空引起市场扰动

### 行情回顾

周四（6月1日），三大指数早盘低开，之后震荡走高，悉数翻红。午后，行情走弱，三大指数震荡下行，沪指翻绿，深指、创指涨幅收窄。尾盘沪指收平，再守 3200 点，深指、创指小幅收红。截至收盘，上证指数（+0.00%）收报 3204.63 点，深证成指（+0.39%）收报 10835.90 点，创业板指（+0.59%）收报 2206.43 点。两市量能小幅上涨，逼近万亿。北向资金净卖出 18.02 亿元。申万 I 级行业过半上涨，传媒、计算机、社会服务领涨，家用电器、公用事业、交通运输领跌。证券 II 上涨 0.21%，43 家上市券商多数下跌，华林证券、东吴证券、中国银河领涨，方正证券、中金公司、首创证券领跌。

### 要闻关注

今日，国家统计局发布数据显示，5 月制造业 PMI 为 48.8%，较上月低 0.4%；

近期，多家券商在数字化与智能化发展方面频频发力。

## 正文目录

一、行情回顾.....	4
二、券商行情.....	5
三、重大事项.....	7

## 图 表 目 录

图表 1	申万 I 级行业日涨跌幅 (%)	4
图表 2	热门行业涨跌幅 (%)	5
图表 3	沪深两市涨跌家数统计 (家)	5
图表 4	申万 I 级行业日资金净流入规模 (亿元)	5
图表 5	上市券商日涨跌幅 (%)	6
图表 6	上市券商日资金净流入规模 (亿元)	7
图表 7	上市券商日换手率 (%)	7

## 一、行情回顾

### ■ 板块表现

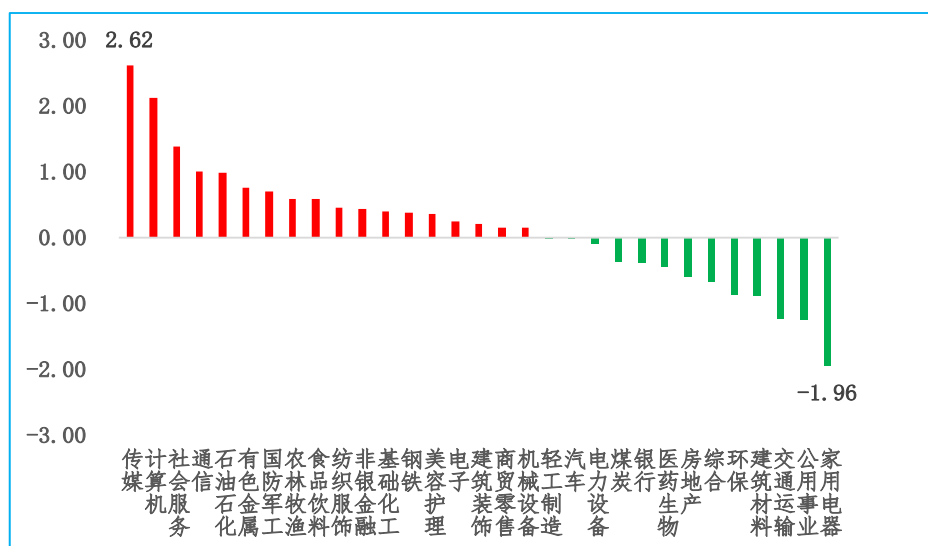
周四（6月1日），三大指数早盘低开，之后震荡走高，悉数翻红。午后，行情走弱，三大指数震荡下行，沪指翻绿，深指、创指涨幅收窄。尾盘沪指收平，再守 3200 点，深指、创指小幅收红。截至收盘，上证指数（+0.00%）收报 3204.63 点，深证成指（+0.39%）收报 10835.90 点，创业板指（+0.59%）收报 2206.43 点，沪深 300（+0.22%）收报 3806.87 点。

今日沪深两市上涨股票为 2568 家，占总体股票比重 56.30%，横盘 184 家，下跌 2214 家。资金流方面，上证指数今日成交额为 4010 亿元，深证成指今日成交额为 5856 亿元，两市成交额 9866 亿元，创业板指成交额 2866 亿元，沪深 300 成交额 2418 亿元。（数据来源：同花顺 iFinD）

当天申万 I 级 31 个行业过半上涨，涨幅最大的三个行业分别是，传媒（申万）（+2.62%）、计算机（申万）（+2.13%）、社会服务（申万）（+1.39%）；另外，跌幅最大的三个行业分别是，家用电器（申万）（-1.96%）、公用事业（申万）（-1.25%）、交通运输（申万）（-1.24%）。

金融板块今日集体上涨，其中非银金融（申万）今日上涨了 0.44%，证券 II（申万）今日上涨了 0.21%，保险 II（申万）今日上涨了 0.92%，多元金融（申万）今日上涨了 0.36%。（数据来源：同花顺 iFinD）

图表 1 申万 I 级行业日涨跌幅（%）



数据来源：同花顺 iFinD 大同证券研究发展部

图表 2 热门行业涨跌幅 (%)

	名称	涨跌幅 (%)
前五	传媒	2.62
	计算机	2.13
	社会服务	1.39
	通信	1.00
	石油石化	1.00
后五	家用电器	-1.96
	公用事业	-1.25
	交通运输	-1.24
	建筑材料	-0.89
	环保	-0.88

数据来源：同花顺 iFinD 大同证券研究发展部

图表 3 沪深两市涨跌家数统计

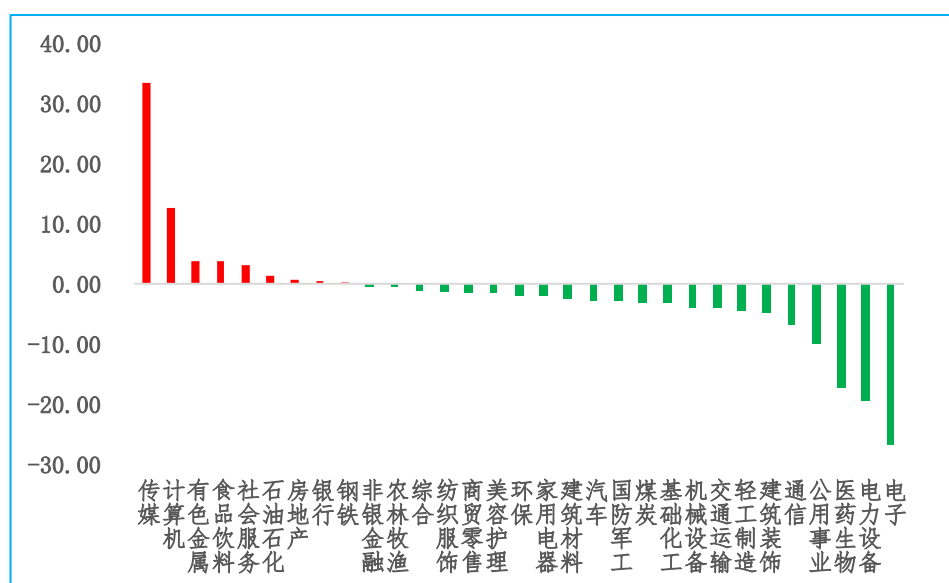
日期	涨跌家数
6月1日	上涨家数 2568
	平盘家数 184
	下跌家数 2214
	涨停家数 52
	跌停家数 25
5月31日	上涨家数 1815
	平盘家数 150
	下跌家数 3000
	涨停家数 60
	跌停家数 20

数据来源：同花顺 iFinD 大同证券研究发展部

## ■ 资金表现

今日申万 I 级行业共 9 个行业呈现主力资金净流入状态,净流入主力资金最多的三个行业分别是,传媒(申万)主力资金净流入 33.64 亿元,计算机(申万)主力资金净流入 12.64 亿元,有色金属(申万)主力资金净流入 3.87 亿元;净流出主力资金最多的三个行业分别是,电子(申万)主力资金净流出 26.64 亿元,电力设备(申万)主力资金净流出 19.31 亿元,医药生物(申万)主力资金净流出 17.19 亿元。

图表 4 申万 I 级行业日资金净流入规模 (亿元)



数据来源：同花顺 iFinD 大同证券研究发展部

## 二、券商行情

## ■ 个股表现

43 家上市券商多数下跌,涨幅最大的三家券商分别是,华林证券(+2.99%)、东吴证券(+1.95%)、中国银河(+1.94%);另外,跌幅最大的三家券商分别是,方正证券(-2.72%)、中金公司(-1.92%)、首创证券(-1.61%)。

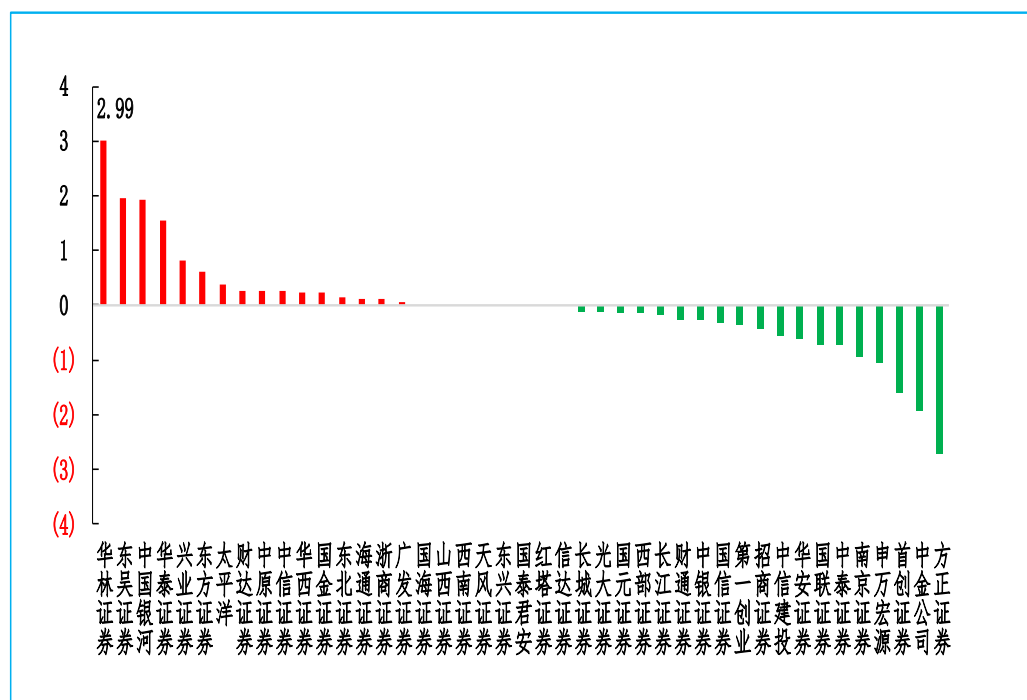
## ■ 资金流向

资金流方面,今日 43 家上市券商共 17 家呈主力资金净流入状态,净流入主力资金最多的三家券商分别是,中信证券主力资金净流入 1.53 亿元,中国银河主力资金净流入 0.53 亿元,华林证券主力资金净流入 0.41 亿元;另外,净流出主力资金最多的三家券商分别是,光大证券主力资金净流出 0.98 亿元,中信建投主力资金净流出 0.37 亿元,中银证券主力资金净流出 0.29 亿元。

## ■ 换手率

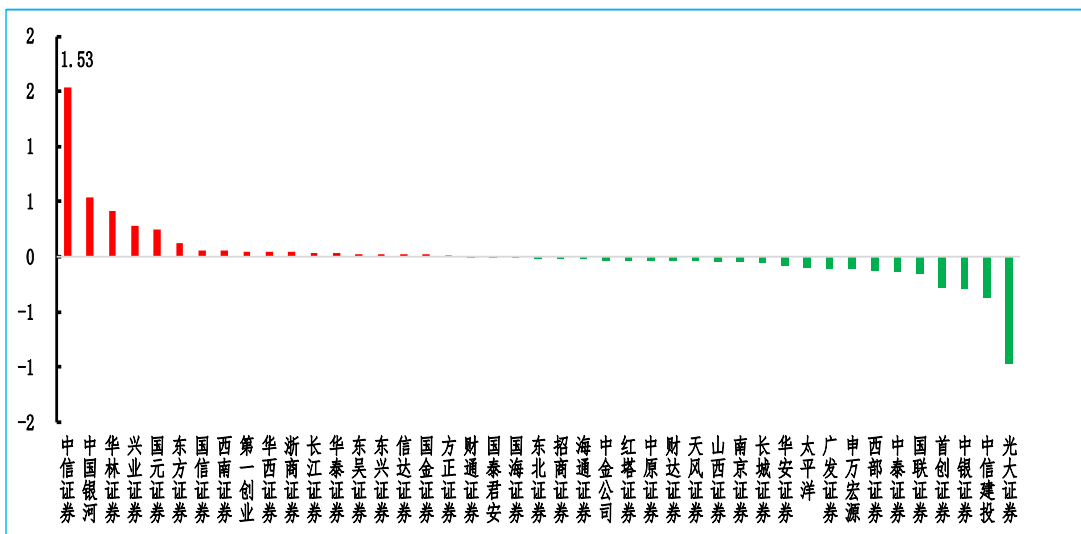
换手率方面,今日活跃度最高的 3 家上市券商分别是,首创证券(8.16%)、信达证券(4.63%)、国联证券(1.86%);活跃度最低的 3 家上市券商分别是,国信证券(0.17%)、招商证券(0.20%)、国泰君安(0.22%)。

图表 5 上市券商日涨跌幅(%)



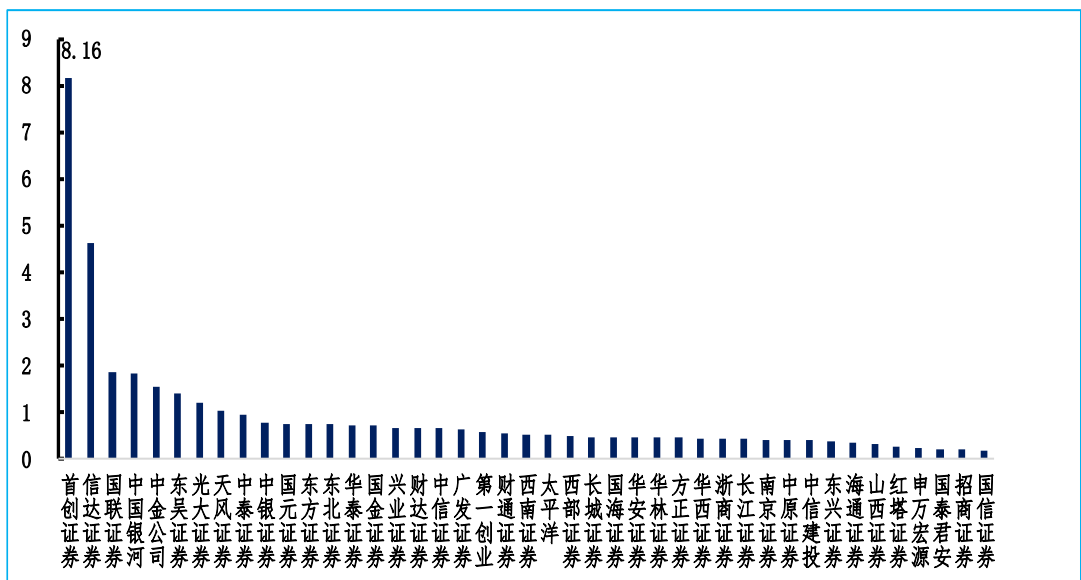
数据来源:同花顺 iFinD 大同证券研究发展部

图表 6 上市券商日资金净流入规模（亿元）



数据来源：同花顺 iFinD 大同证券研究发展部

图表 7 上市券商日换手率（%）



数据来源：同花顺 iFinD 大同证券研究发展部

### 三、重大事项

#### ■ 券商“数智化”又有新动作 多维度向发展新模式转型

“海通证券数智人 2.0 焕新升级上线”“东吴证券与同花顺正式签约，双方将联合成立 AI 研究院”“华安证券亮相数字中国建设峰会”……近期，券商在数字化与智能化发展方面动作频频。

资料来源: <http://www.zqrb.cn/jrjg/quanshang/2023-06-01/A1685547476590.html>

### ■ 重磅出炉!前5月主动权益基金收益-1.59% 最牛基金收益超60%

数据显示,今年前5月整体主动权益基金收益已“由正转负”,整体出现了1.59%的亏损,尽管未能跑赢上证指数,不过主动权益“最牛者”收益已超60%。

资料来源: <https://finance.eastmoney.com/a/202306012739207416.html>

### ■ 国家统计局:5月制造业PMI为48.8% 比上月下降0.4个百分点

5月份,制造业采购经理指数(PMI)为48.8%,比上月下降0.4个百分点,低于临界点,制造业景气水平小幅回落。从企业规模看,大型企业PMI为50.0%,比上月上升0.7个百分点,位于临界点;中、小型企业PMI分别为47.6%和47.9%,比上月下降1.6和1.1个百分点,低于临界点。

资料来源: <https://finance.eastmoney.com/a/202305312737521671.html>



### 大同证券投资评级的类别、级别定义：

类别	级别	定义
股票评级	强烈推荐	预计未来 6~12 个月内，股价表现优于市场基准指数 20% 以上
	谨慎推荐	预计未来 6~12 个月内，股价表现优于市场基准指数 10% ~20%
	中性	预计未来 6~12 个月内，股价波动相对市场基准指数-10% ~+10%
	回避	预计未来 6~12 个月内，股价表现弱于市场基准指数 10% 以上
	‘+’ 表示市场表现好于基准，‘-’ 表示市场表现落后基准	

类别	级别	定义
行业评级	看好	预计未来 6~12 个月内，行业指数表现强于市场基准指数
	中性	预计未来 6~12 个月内，行业指数表现跟随市场基准指数
	看淡	预计未来 6~12 个月内，行业指数表现弱于市场基准指数

注 1：公司所处行业以交易所公告信息为准

注 2：行业指数以交易所发布的行业指数为主

注 3：基准指数为沪深 300 指数

### 分析师声明：

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注册分析师，本报告准确客观反映了作者本人的研究观点，结论不受第三方授意或影响。在研究人员所知情的范围内本公司、作者以及财产上的利害关系人与所评价或推荐的证券不存在利害关系。

本报告采用的研究方法均为定性、定量相结合的方法，本报告所依据的相关资料及数据均为市场公开信息及资料(包括但不限于：Wind/国家统计局/公司官网等)，做出的研究结论与判断仅代表报告发布日前的观点，具备一定局限性。

### 免责声明：

本报告由大同证券有限责任公司(已具备中国证监会批复的证券投资咨询业务资格)制作。本报告所载资料的来源及观点皆为公开信息，但大同证券不能保证其准确性和完整性，因此大同证券不对因使用此报告的所载资料而引致的损失负任何责任。

本报告所载的意见、评估及预测仅为本报告出具日的观点和判断。本公司不保证文中观点或陈述不会发生任何变更，在不同时期，本公司可发出与本报告所载资料、意见及推测不一致的报告。

市场有风险，投资需谨慎。此报告仅做参考，并不能依靠此报告以取代独立判断。本报告仅反映研究员的不同设想，见解及分析方法，并不代表大同证券有限责任公司。

### 特别提示：

1、投资者应自主做出投资决策并自行承担投资风险，任何形式的分享证券投资收益或者分担证券投资损失的书面或口头承诺均为无效。

2、未经允许投资者不得将证券研究报告转发给他人。

- 3、投资者需慎重使用公众媒体刊载的证券研究报告。
- 4、本报告预计发布时间可能会受流程等因素影响而延迟，但最大延迟不会超一周。

**版权声明：**

本报告版权为大同证券有限责任公司所有，未经书面许可，任何机构和个人不得以任何形式翻版、复制和发布。如引用需注明出处为大同证券研究部，且不得对本报告进行有悖原意的引用、删节和修改。