

最近几天，金融圈、腾讯网等各大财经媒体流传一个新闻：全国社保基金去年亏损5%！笔者认为这个数据大概率是真实的。今天的量化大数据选股策略，就为大家分享A股市场5300多只股票中被全国社保基金重仓的那些亏损股。



通过这100只股票在沪深两市各个板块的分布比例，我们可以发现，全国社保基金更倾向于重仓投资沪市主板上市公司，占比55%；其次投向市值较小的深市中小板上市公司，占比30%；对于风险较大、波动性较高的创业板，社保基金仅投放了15%的资金量。



全国社保基金，一般由成立时间较早、主动管理资金规模较高的公募基金公司代为

，操盘者也多为高学历、证券从业时间长、投资经验丰富的基金经理。

本期数据筛选范围为最近一年（下表第三列），2022年9月30日到2023年9月28日，社保持股市值和社保持股家数统计数据来自2023年发布的半年报数据。

最近一年跌幅最高的社保基金持仓股是来自宁波的热交换器、光伏逆变器、储能、除湿机概念股——德业股份，跌幅-67%。



给大家上一张德业股份大宗交易趋势图，看上图，在股价240元的价格区间，密集交易的几笔大宗交易（上图蓝框内），用后视镜的视角，有没有被坑杀的感觉？！

资本市场，就

是没有硝烟的战场，大鱼吃

小鱼，就是这么地血淋淋；

社保基金804组合，在社保基金1202组合、303组合的试探之后，精准抄底，摘到了最后的果实。