

2013年08月16日 星期五

每日视点·股指

埃及【评级：多平】

✉:dept_paqhyjs@pingan.com.cn
 研究所 股指研究小组
 ✉:dept_paqhtzxb@pingan.com.cn
 投资咨询部 整理/分发

✍:李 斌 (策略研究)

☎:86-755-82563929

✉:libin719@pingan.com.cn

🏠:期货从业资格:F0271067

🏠:投资咨询资格:Z0002714

✍:樊继拓 (策略研究)

☎:86-755-23991748

✉:FANJITUO102@pingan.com.cn

🏠:期货从业资格:F0290532

一、【要闻聚焦】

全球热点新闻	8月15日纽市尾盘，盘初在良好美国初请和CPI数据提振下，美元指数一度触及逾一周高位81.95；随后在疲软美国工业产出和联储制造业打压下，美指回落至81.65附近；紧接着盘中美指突然跳水近40点，并一度触及三日低位81.09。对于美元突然跳水有分析师给出了“雷人”的解释——一是受到股市、金市拖累。	
	上证报	两年后终成行 招行350亿A+H融资将启动 两大电网为新能源护航 光伏行业再掀热潮
国内头条	中证报	乳粉企业将掀兼并重组潮
		传发改委调查进口车商操纵价格 外资车企否认
		老凤祥等5金店2012年在上海不法营业收入超10亿
	证券时报	国务院近期将出台鼓励信息消费方案
		美国房屋建筑商信心指数创8年新高
和讯网	6月外国私人投资者抛售美国中长期国债创纪录	
	死多头缴枪 鲍尔森削减53%黄金持仓	
网络媒体话题排行	热度指数	热门股市话题
	1	指纹
	2	信息消费
	3	指纹识别
	4	电商
	5	涨价
	6	身份证指纹
	7	涨价概念
	8	博彩
	9	传感器
10	身份证	

图1：月度宏观数据

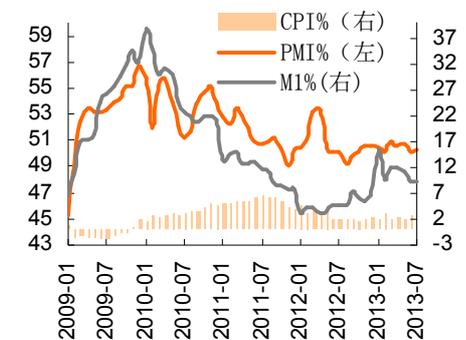
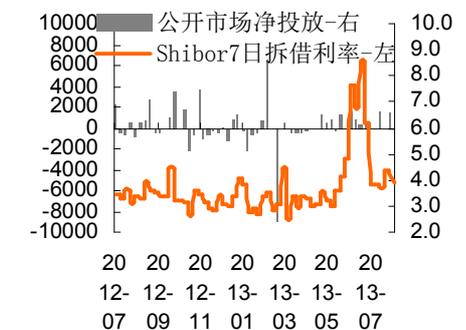


图2：日数据-公开市场及拆借利率



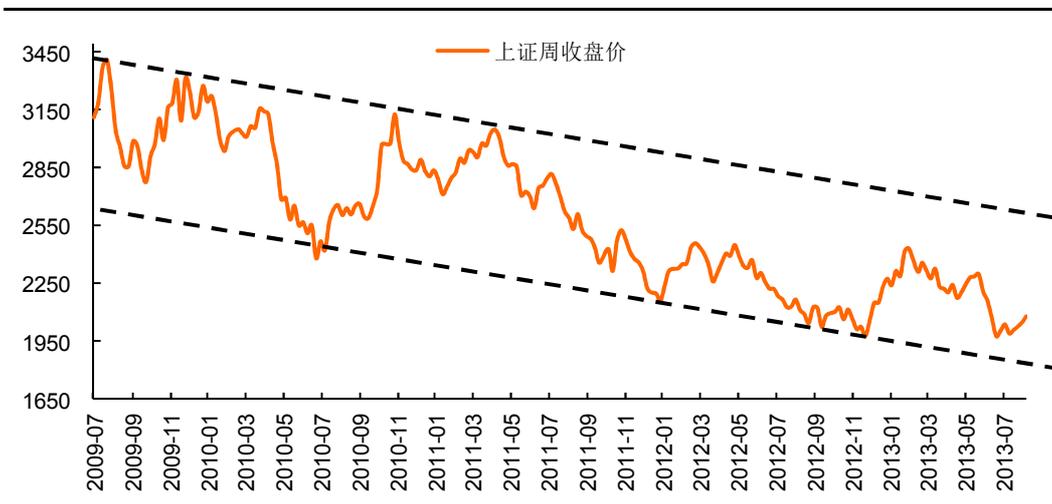
资料来源：平安期货研究所

资料来源：平安期货研究所

二、【单边交易策略】

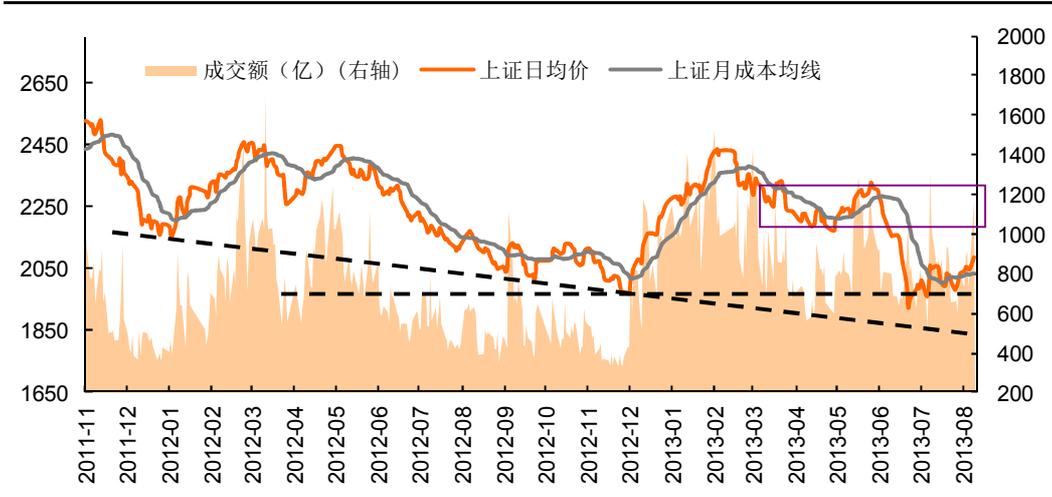
1、波段趋势：周线处于下跌上涨临界、日线级别处于上涨波段

图2-1:上证周K线图：多空临界，震荡剧烈



资料来源:wind、平安期货研究所

图2-2:上证日K线图：受阻于60日均线及2100关口



资料来源:wind、平安期货研究所

2、综合论市

外围方面，美国上周初请失业金人数降至 32.0 万，创 07 年 10 月以来的新低。7 月 CPI 环比上升 0.2%，年率升幅为 5 个月以来的最高水平。美国 7 月工业生产环比持平，大幅低于预期的增长 0.3%。总体来看，尽管美国数据好坏不一，但就业和通胀数据重要性相对较高，使得美联储在下月开始缩减量化宽松措施规模的预期进一步升温，投资者对流动性供给前景感到悲观，致使昨日美股大跌。另一方面，埃及局势进一步恶化的状况，也引发强烈避险预期，隔夜黄金的跳涨先于美元，资金有回归贵金属规避战争的风险。

国内方面，杭州推出了可以流通的经济适用房，这一形式其实是在试水房地产调控长效机制。房地产调控长效机制的建立包括土地、金融、财税等政策的调整。建立

房地产调控长效机制的一个原则是去行政化，逐步让市场发挥调节作用。近期，一线城市房价“高烧不退”，而部分二三线城市则上演“空城计”，这让政府开始反思过度行政化的调控，以后的调控必将更加灵活。

综合来看，埃及局势所导致的全球股市大跌对今日 A 股的表现带来一定的负面影响，中东局势在未来还有恶化的可能，而本轮 A 股的反弹已延续接近 2 个月，9 月是围绕美联储政策的博弈期，节奏较难把握，建议前期获利多单可先离场，等待下一轮的趋势投资机会。

行情预判：日内交易（基于 30 分钟图表）震荡上行—多头平仓

短线波段交易（基于日线图表）：震荡上行—多头平仓

中长线波段交易（基于周线图表）：盘整—中性观望

短线买卖评级：多平。

（评级共 11 档：多开、多持、多减、多增、多平、中性、空开、空持、空减、空增、空平）

3、观点日历

图2-3:近2个月观点汇总

2013年07月 癸巳蛇年 股指观点回顾							公元2013年08月 癸巳蛇年 股指观点回顾						
日	一	二	三	四	五	六	日	一	二	三	四	五	六
	1	2	3	4	5	6					1	2	3
	中性	中性	中性	中性	中性						空持	多开	
7	8	9	10	11	12	13	4	5	6	7	8	9	10
	中性	无	中性	多开	多持			多持	无	多持	多持	多持	
14	15	16	17	18	19	20	11	12	13	14	15	16	17
	多持	多持	多持	多持	多持			多持	多持	多持	多持	多平	
21	22	23	24	25	26	27	18	19	20	21	22	23	24
	多平	中性	多开	多持	多平								
28	29	30	31				25	26	27	28	29	30	31
	空开	空减	空持										

资料来源:平安期货研究所

三、【重点数据监测】

日期	收盘价	成交额 (亿)	市盈率 (TTM)	流通市值 (万亿)	IF主力收盘价	涨跌幅 (结算价) %	日持仓变化	五大多头持仓	五大空头持仓	五大净多持仓
2013-08-15	2,081.880	847	10.27	13.15	2324.2	-1.0	-8331	3489	5433	-1944
2013-08-14	2,100.137	958	10.36	13.26	2349	-0.1	-21748	6307	8210	-1903
2013-08-13	2,106.156	964	10.39	13.30	2354.6	0.2	-16741	13928	16957	-3029
2013-08-12	2,101.283	1,165	10.37	13.26	2348.4	3.0	1356	18522	25343	-6821
2013-08-09	2,052.235	830	10.14	12.94	2288.2	0.7	-4953	16384	20458	-4074
2013-08-08	2,044.895	720	10.11	12.90	2265.4	-0.3	-1704	16674	23985	-7311
2013-08-07	2,046.778	913	10.12	12.92	2258.4	-0.8	-2821	19241	24635	-5394
2013-08-06	2,060.500	887	10.19	13.00	2278.8	1.0	629	18233	27143	-8910
2013-07-30	1,990.064	662	9.86	12.58	2168.2	1.0	4278	18558	26751	-8193

日期	期货涨幅第一	期货涨幅第二	期货跌幅第一	期货跌幅第二	沪深涨幅第一板块	涨幅第二板块	涨幅第三板块	沪深跌幅第一板块	跌幅第二板块	跌幅第三板块
2013-08-15	白银	白糖	PVC	橡胶	铁路运输	其他采掘	农业综合	林业	医药商业	畜禽养殖
2013-08-14	焦炭	棉花	白糖	塑料	计算机应用	酒店	网络服务	渔业	电子制造	食品加工制造
2013-08-13	白银	焦炭	强麦	锌	电子制造	林业	畜禽养殖	食品加工制造	采掘服务	白色家电
2013-08-12	焦炭	股指	塑料	PTA	煤炭开采	有色金属冶炼与加工	保险	传媒	电子制造	计算机应用
2013-08-09	白银	橡胶	塑料	PTA	有色金属冶炼与加	金属非金属新材料	其他采掘	医疗服务	计算机应用	网络服务
2013-08-08	橡胶	铜	塑料	早籼稻	电子制造	酒店	动物保健	证券	房地产开	非汽车交
2013-08-07	玻璃	螺纹钢	甲醇	棕榈油	酒店	房地产开发	服装家纺	计算机应用	网络服务	通信设备
2013-08-06	橡胶	股指	黄金	白银	汽车整车	旅游综合	交运设备服	环保工程及	建筑装饰	航运

日期	期货五日涨幅第一	期货五日涨幅第二	期货五日涨幅第三	期货五日跌幅第一	期货五日跌幅第二	期货五日跌幅第三	日期	道琼斯工业五日涨幅%	恒生指数五日涨幅%	德国DAX五日涨幅%
2013-08-15	白银 9.86%	焦炭 9.02%	菜籽油 5.29%	塑料 -2.53%	PVC -1.39%	强麦 -0.85%	2013-08-15	-2.51	4.03	1.44
2013-08-14	焦炭 11.87%	橡胶 9.78%	白银 8.78%	塑料 -2.47%	玉米 -0.86%	强麦 -0.85%	2013-08-14	-0.86	4.35	2.14
2013-08-13	焦炭 11.64%	橡胶 10.29%	白银 7.78%	塑料 -1.30%	玉米 -0.78%	棉花 -0.44%	2013-08-13	-0.44	2.82	1.4
2013-08-12	橡胶 9.78%	焦炭 7.84%	铜 5.63%	棕榈油 -2.13%	塑料 -2.06%	豆油 -1.83%	2013-08-12	-1.24	0.27	-0.45

资料来源：同花顺、平安期货研究所

风险提示:

期货市场是一个风险无时不在的市场。您在进行交易时存在赢利的可能，也存在亏损的风险。请您务必对此有清醒的认识，认真考虑是否进行证券，期货交易。市场有风险，投资需谨慎。

免责条款:

此报告旨在发给平安期货有限公司（以下简称“平安期货”）的特定客户及其他专业人士。未经平安期货事先书面明文批准，不得更改或以任何方式传送、复印或派发此报告的材料、内容及其复印本予任何其它人。

平安期货可发出其它与本报告所载资料不一致及有不同结论的报告。本报告及该等报告反映编写分析员的不同设想、见解及分析方法。报告所载资料、意见及推测仅反映分析员于发出此报告日期当日的判断，可随时更改。此报告所指的期货、期权和证券价格、价值及收入可跌可升。为免生疑问，此报告所载观点并不代表平安期货有限公司的立场。

平安期货有限公司版权所有。保留一切权利。

中国平安 PINGAN

平安期货有限公司

地址：深圳市福田区中心区福华三路88号时代财富大厦26楼

客服：400 8888 933

电话：0755-8378 8578

传真：0755-8378 5241

邮编：518031

网址：<http://futures.pingan.com>