

2013年08月09日 星期五

每日视点·股指

数据考验，缓释犹疑【评级：多持】

一、【要闻聚焦】

全球热点新闻	8月8日亚市早盘，美元指数震荡整理，现交投于81关口上方。隔夜美元兑主要货币连跌第五日，盘中一度触及七周低位81.01，五天来累计跌幅达1.48%。美元指数的走弱显然与非美货币的整体强势不无关系，此外，围绕美联储何时开始缩减刺激规模的不确定性也仍令美元承压。	
	上证报	经济向好信号传递 经济数据或舒缓市场犹疑心态 工信部专项整治黑客地下产业链 增强信息产业竞争力
国内头条	中证报	券商欲绕过第三方存管设理财账户
		多省预警财政收入紧张：明年将是最困难一年
	证券时报	上交所解密信用账户 精准牛散突击入股遭曝光
		房企再融资开闸或渐进式推进
		7月份CPI今日公布 涨幅或回升至2.8% 热议
和讯网	[预测] 分析称CPI低于3%可能性较大 PPI降幅有望进一步收窄	
	[数据] 贸易数据再遭外媒质疑 7月铁路货运环比大幅下降16%	
网络媒体话题排行	和讯网	[评论] 7月外贸增速超预期 传递经济向好信号 全球经济弱复苏
	热度指数	统计局今将公布7月CPI 或升至2.8%
		和讯经济学家预测CPI或升至2.9% PPI或至-2.2%
		热门股市话题
	1	微信
	2	手游
	3	食品安全
	4	柔性电路板
	5	稀土
	6	光伏
7	asking	
8	特斯拉	
9	5G	
10	民生电商	

资料来源：平安期货研究所

✉: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

图1：月度宏观数据

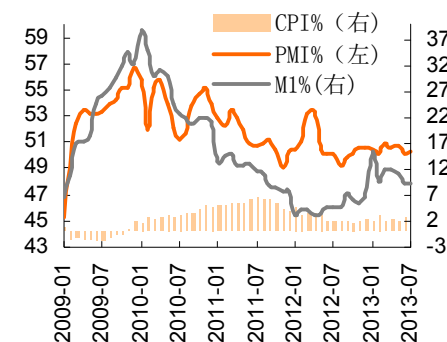
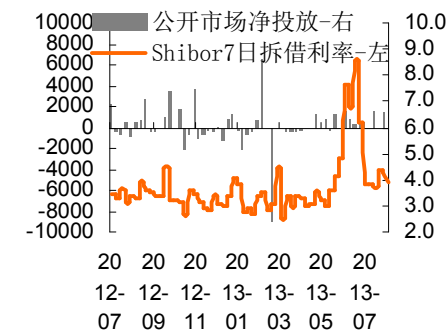


图2：日数据-公开市场及拆借利率

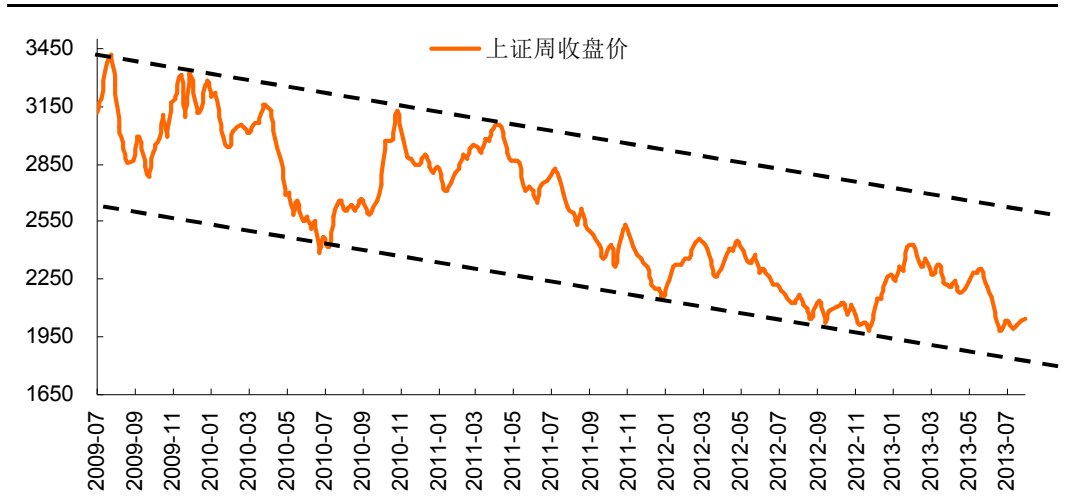


资料来源：平安期货研究所

二、【单边交易策略】

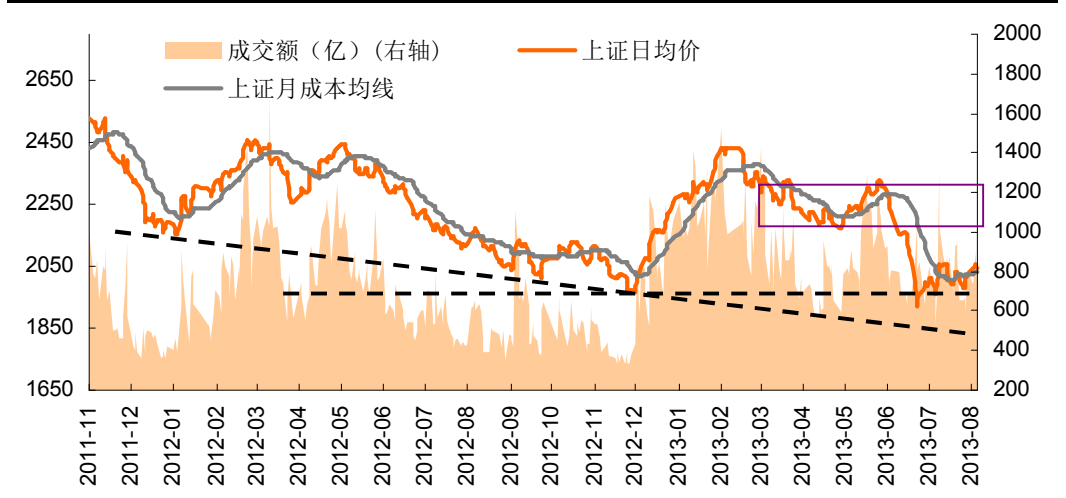
1、波段趋势：周线处于下跌上涨临界、日线级别处于上涨波段

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: 上证日线K线图：第三次冲关



资料来源:wind、平安期货研究所

2、综合论市

外围方面，隔夜公布的美国8月3日当周初请失业金人数为33.3万人，不及预期的33.6万。由于上周的非农数据疲弱，美联储将何时开始缩减购债的不确定性增强。也为市场赢来一定的喘息之机。

国内方面，昨日海关总署发布今年7月份我国外贸情况，中国7月出口同比增5.1%，进口增10.9%，上半年外贸进出口放缓寒流有所缓解。该数据一度引发昨日澳元大涨。此外，国家统计局今日9:30将公布7月份居民消费价格指数(CPI)和工业生产者价格指数(PPI)。此间多家机构预测，受蔬菜和猪肉价格上涨影响，7月份CPI涨幅或回升至2.8%左右(前值2.7%)，而PPI同比降幅则有望进一步收窄。13:30将公布工业增加值(前值8.9%)，该数据与GDP高度相关，可据此观察经济是否企稳。

综合来看，QE 退出时间延后对市场情绪有所支撑，今天的数据将刺激市场的活跃度，可积极参与日内交易。技术形态方面，上证近期围绕 5 日线震荡，周级别的下跌形态需要一定时间修复，但蓄势之后，料未来仍有希望上冲 2110 处（60 日均线）。操作上，前期多头可继续持有。

行情预判：日内交易（基于 30 分钟图表）震荡上行—多头持有

短线波段交易（基于日线图表）：震荡上行—多头持有

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：多持。

（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								
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
2013-08-08	2,044.895	720	10.11	0.00	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
2013-08-05	2,050.481	733	10.15	12.95	2265.8	1.1	3823	17515	27214	-9699
2013-08-02	2,029.418	789	10.04	12.82	2240	0.6	-7178	18217	26551	-8334
2013-08-01	2,029.067	774	10.04	12.82	2244.2	2.5	2103	19997	29908	-9911
2013-07-31	1,993.799	594	9.88	12.60	2165	0.2	-245	18769	26545	-7776
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
2013-08-08	橡胶	铜	塑料	棕榈油	电子制造	酒店	动物保健	证券	房地产业	非汽车零配件
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	交通运输	环保工程及服务	建筑装饰	航运
2013-08-05	股指	菜籽油	早籼稻	豆油	饲料	畜禽养殖	渔业	餐饮	通信运营	#N/A
2013-08-02	棕榈油	焦炭	黄金	早籼稻	畜禽养殖	电子制造	房地产开发	金属制品	传媒	水务
2013-08-01	股指	铜	白银	甲醇	计算机应用	传媒	医疗服务	#N/A	石油开采	餐饮
2013-07-31	豆一	棕榈油	白糖	铝	环保工程及服务	通信设备	医疗服务	林业	金属非金属新材料	计算机设备
2013-07-30	甲醇	铅	橡胶	白银	餐饮	多元金融	其他采掘	网络服务	医疗服务	计算机设备

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%
2013-08-08	橡胶	铜	焦炭	黄金	早籼稻	豆油	2013-08-08	-0.84	-1.96	-1.09
2013-08-07	股指	橡胶	铜	黄金	早籼稻	白银	2013-08-07	-0.19	-1.33	-0.16
2013-08-06	股指	橡胶	豆一	早籼稻	黄金	白银	2013-08-06	-0.02	-0.12	0.37
2013-08-05	股指	PTA	橡胶	早籼稻	白银	黄金	2013-08-05	0.57	1.7	1.69

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>