

2013年10月18日 星期四

每日视点·股指

临界，数据能否救命【评级：空持】

✉: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

一、【要闻聚焦】

全球热点新闻	尽管市场人士早已预料到10月17日将是一个重要的交易节点，但相信没有多少人能预料到当天的行情竟然如此惊心动魄。周四，抛售美元成为了市场的主要趋势，美元指数大跌超过1%，跌至80整数关口以下。欧元兑美元汇价则创出8个月以来新高，澳元兑美元汇价也刷新4个月高点。	
	上证报	扰动因素不可忽略 经济增长动力能否持续？ 钢材市场疲软 铁矿石期货上市首日或低走
国内头条	中证报	自贸区虚拟地址注册虚热 上海大妈“团购”壳公司 社科院报告建议加快推行房产税 提高个税起征点 三季度GDP今公布 全年增速料超预期
		工信部奶业重组方案揭盖：只留50家配方奶粉企业
	证券时报	泥沙俱下 布局改革创新主线 情绪市特征渐显 回调藏布局良机 治癌现新突破 抗癌风刮向味精概念股 二胎政策预期提振概念股 生态文明题材火爆 兔宝宝大涨 QFII大本营大宗交易狂买蓝筹股 中石油万人大会通报四高管被查 不影响正常经营 股价遭遇重挫
		和讯网
网络媒体话题排行	热度指数	热门股市话题
	1	再战杯
	2	电力
	3	大数据
	4	上证早知道
	5	融资融券
	6	优先股
	7	职业炒手杯
	8	民营医院
	9	煤炭
10	成都雷立刚	

✍: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

图1：月度宏观数据

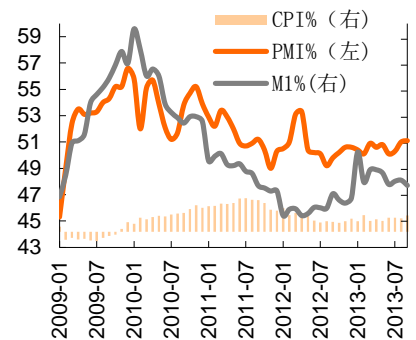
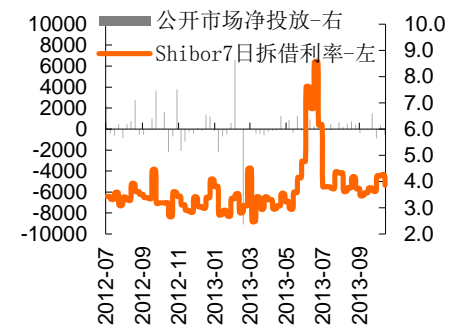


图2：日数据-公开市场及拆借利率



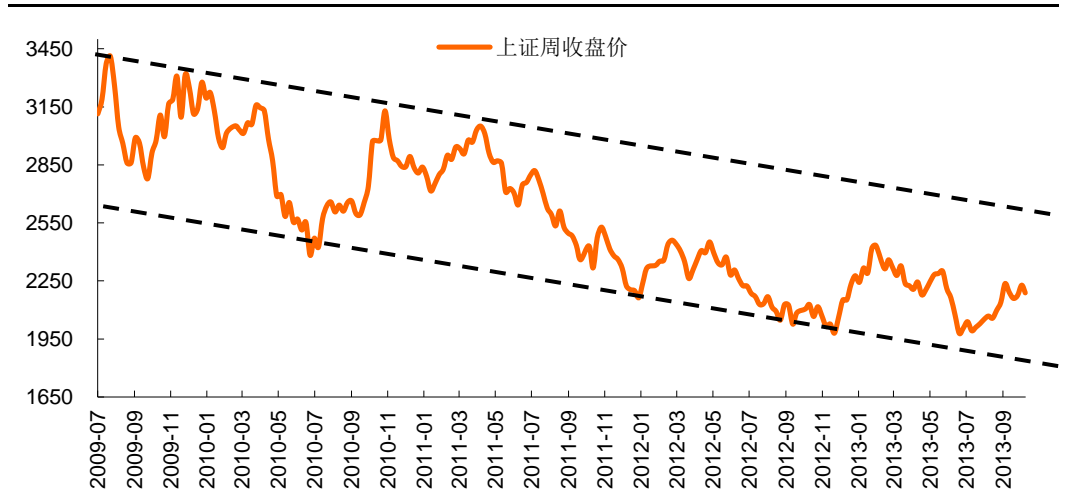
资料来源：平安期货研究所

资料来源：平安期货研究所

二、【单边交易策略】

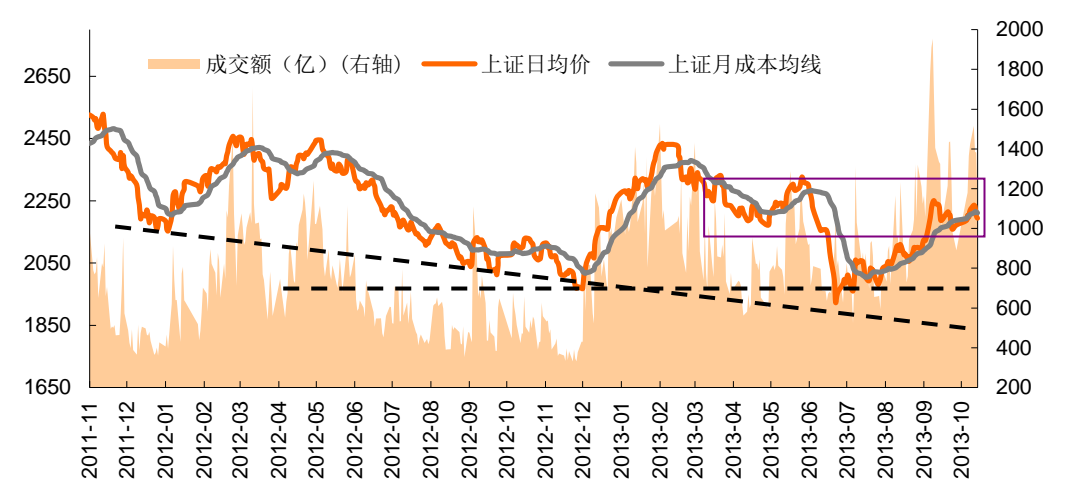
1、波段趋势：周线处于上涨下跌临界、日线级别处于下跌波段

图2-1: 上证周K线图



资料来源:wind、平安期货研究所

图2-2: 上证日K线图



资料来源:wind、平安期货研究所

2、综合论市

外围方面，财政僵局过去几周已经对美国经济造成了一定的伤害，仅仅是美国可能出现违约的威胁也令美国借款成本上升，财政赤字增加，美国经济复苏的步伐是否收到影响，由此美联储的 QE 决定又会怎样，这两点将成为市场的焦点。此外，昨天，一度有坊间传闻称惠誉可能会取消美国 AAA 最高评级，美元重挫 1%，黄金价格大幅反弹 3%，而美国原油期货价格则下跌至逼近 100 美元整数心理关口处。

国内方面，周四，公开市场暂停了常规的 14 天逆回购，当日的零操作令本周重返净回笼 445 亿，结束了此前的净投放，这是自 7 月底本轮逆回购开展以来，央行首次暂停逆回购操作。央行周三向市场释放了“银行体系流动性供应仍比较充裕”的信号，周四便果断在公开市场暂停了逆回购操作。当下流动性相对均衡，是此次逆回购暂停

的原因，在外汇流入明显增加的背景下，持续近三个月的逆回购有望告一段落，未来不排除相机重启正回购或央票的可能性。

综合来看，昨天，一度有坊间传闻称惠誉可能会取消美国 AAA 最高评级，美元重挫 1%，黄金价格大幅反弹 3%，而美国原油期货价格则下跌至逼近 100 美元整数心理关口处。国内方面，今天将公布工业增加值、消费、投资和 GDP 的数据，需要密切关注，预计经济数据会显示经济继续企稳，但是相比较 8 月份的大幅上升，9 月份估计只是微升。操作建议：如果经济数据没有靓丽的表现，股指的空头仍可继续持有，甚至小幅加仓。关注 2400 点的重要关口。

行情预判：日内交易（基于 30 分钟图表）盘整—逢高沽空

短线波段交易（基于日线图表）：盘整—看空

中长线波段交易（基于周线图表）：盘整—中性

短线买卖评级：空持。

（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

2013年09月 癸巳蛇年 股指观点回顾							公元2013年10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	7			1	2	3	4	5
	空持	空持	空持	空持	空持				无	无	无	无	
8	9	10	11	12	13	14	6	7	8	9	10	11	12
	空减	多开	多持	多持	多持			无	中性	中性	中性	中性	
15	16	17	18	19	20	21	13	14	15	16	17	18	19
	多减	中性	中性	无	无			中性	中性	中性	空开	空持	
22	23	24	25	26	27	28	20	21	22	23	24	25	26
	中性	中性	中性	中性	无		十六	十七	十八	霜降	二十	廿一	廿二
29	30						27	28	29	30	31		
	中性												

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
2013-10-17	2,188.542	1,131	10.44	13.96	2411	-0.2	-19502	6569	10031	-3462
2013-10-16	2,193.074	1,382	10.46	13.98	2426.4	-1.6	-8863	11620	17898	-6278
2013-10-15	2,233.412	1,385	10.63	14.22	2461.4	-0.4	-6028	13737	20831	-7094
2013-10-14	2,237.773	1,516	10.67	14.25	2468.8	0.1	-1679	15449	24211	-8762
2013-10-11	2,228.146	1,423	10.63	14.19	2466	1.6	-5665	16081	26634	-10553
2013-10-10	2,190.929	1,366	10.45	13.95	2429	-0.8	-3721	16580	28274	-11694
2013-10-09	2,211.769	1,180	10.55	14.09	2457	0.2	-391	18432	28958	-10526
2013-10-08	2,198.199	1,150	10.49	14.00	2440	1.4	2446	17310	31584	-14274
2013/08/27	2,103.567	1,046	10.06	13.33	2342	0.0	-54	0	0	0

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
2013-10-17	棕榈油	豆油	橡胶	PTA	水务	林业	农业综合	交运设备服务	传媒	餐饮
2013-10-16	豆油	黄金	焦炭	股指	渔业	其他轻工制造	燃气	园区开发	农业综合	林业
2013-10-15	橡胶	玻璃	菜粕	白银	渔业	医疗服务	餐饮	旅游综合	计算机设	零售
2013-10-14	橡胶	焦炭	白银	黄金	林业	种植业	餐饮	园区开发	公交	银行
2013-10-11	橡胶	股指	豆粕	菜粕	园区开发	公交	石油化工	传媒	视听器材	种植业
2013-10-10	棕榈油	豆一	白银	黄金	零售	白色家电	视听器材	传媒	航运	证券
2013-10-09	焦炭	玻璃	白糖	铜	种植业	港口	采掘服务	通信运营	电子制造	煤炭开采
2013-10-08	白银	白糖	甲醇	黄金	通信运营	环保工程及	饲料	景点	铁路运输	传媒

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%
2013-10-17	棕榈油 2.98%	铅 2.93%	白糖 2.41%	菜粕 -6.09%	豆粕 -4.85%	白银 -4.59%	2013-10-17	1.63	0.64	1.83
2013-10-16	橡胶 3.37%	棕榈油 3.09%	铅 2.82%	菜粕 -7.19%	白银 -6.31%	豆粕 -5.28%	2013-10-16	3.82	0.85	3.82
2013-10-15	橡胶 4.92%	焦炭 4.13%	棕榈油 3.63%	白银 -6.52%	菜粕 -5.54%	豆粕 -5.46%	2013-10-15	2.64	0.68	2.89
2013-10-14	塑料 6.02%	棕榈油 5.56%	橡胶 5.00%	黄金 -5.23%	豆粕 -3.12%	白银 -2.78%	2013-10-14	2.44	1.06	1.55

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>