

2013年09月11日 星期三

每日视点·股指

# 外稳内热【评级：多持】

✉: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	9月10日纽市尾盘，美元指数在日内冲击82.00无果后回落至平盘附近，而日元则因为日内市场风险偏好的继续好转而继续走低。此前，数据显示中国8月份的各方面经济基本面状况进一步向好，这进一步提振了风险偏好情绪。而叙利亚局势在貌似进入最危急关头时却峰回路转的状况，也一度刺激了市场情绪好转。	
	上证报	趋势学家里夫金：中国具备开展新工业革命优势 电子新品密集发布 机构关注NFC应用 指纹识别成5S亮点
国内头条	中证报	上市公司涉房重组与再融资申报要求出炉 博鳌论坛秘书长：新兴经济体高速增长时代已终结 多机构申设民营银行 外滩金融试验区细则落地
		周小川：推进改革支持金融创新
		趋势向好 基本面接力题材 银行股单日融资买入额创历史新高 汇丰渣打望入驻自贸区(附股) 指纹识别成iphone5s亮点(附股) 中国重工定增募资吸纳军工资产 中信证券迎“重工”大礼包 落马高管均曾执掌肥缺 反腐风暴未尽终曲 董事长：要管住自己
	和讯网	李克强：坚定推进中国金融改革 出席夏季达沃斯答问 总理农民两岗位无贵贱之分
	证券时报	（内容同上）
网络媒体话题排行	热度指数	热门股市话题
	1	丝绸之路概念股
	2	核桃
	3	丝绸之路经济带
	4	军工
	5	新疆
	6	参股金融
	7	优先股
	8	房地产
	9	丝绸之路
	10	天津

✍: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

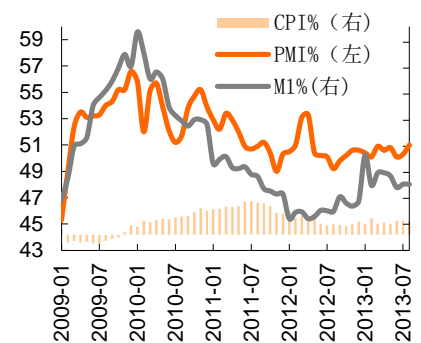
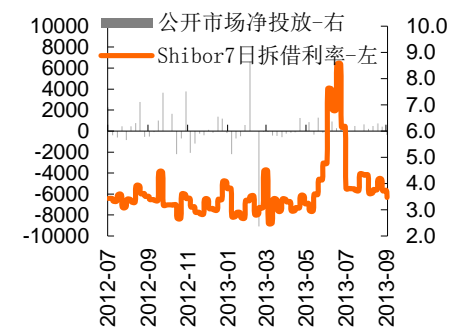


图2：日数据-公开市场及拆借利率



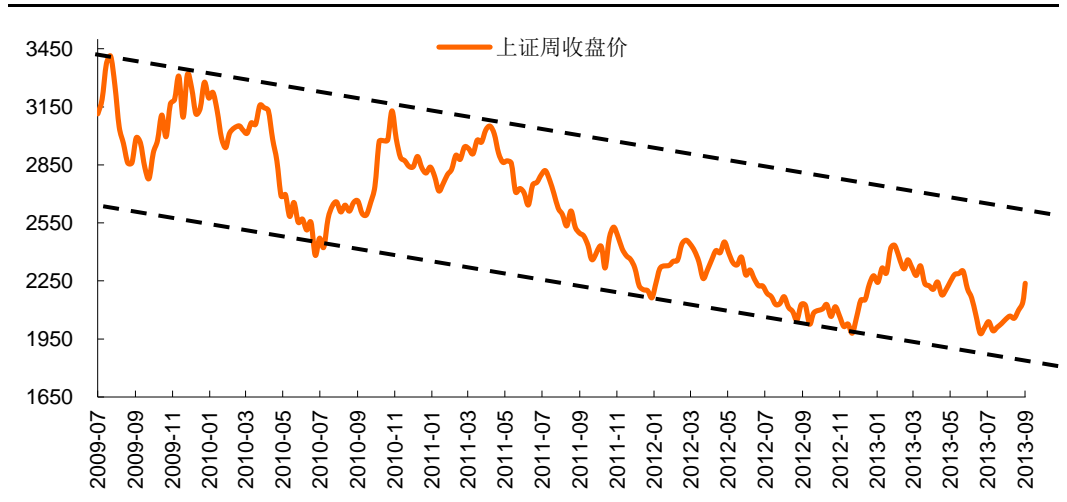
资料来源：平安期货研究所

资料来源：平安期货研究所

## 二、【单边交易策略】

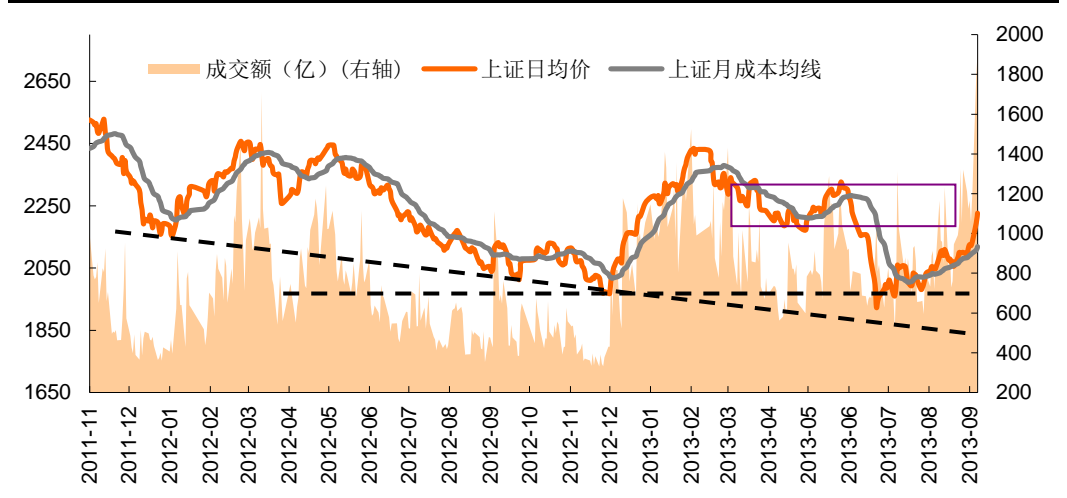
### 1、波段趋势：周线处于下跌上涨临界、日线级别处于上涨下跌临界

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：博弈经济数据



资料来源:wind、平安期货研究所

## 2、综合论市

外围方面，奥巴马此前已经提议国会推迟对叙利亚动武的表决时间，以便给各方更多考虑的时间，反映出叙利亚动武的决议很有可能存在变数。在此背景下，全球汇市在纽约时段再度陷入胶着。受叙利亚局势趋向乐观的影响，国际原油价格在周二连续第二天大幅下跌，而黄金价格也继续探底。欧洲方面，需要引起警惕的是意大利政治局势继续恶化，后期可能对市场产生较大影响。

国内方面，8月规模以上工业增加值同比实际增长10.4%，比7月加快0.7个百分点，8月消费同比增长13.4%，较7月上升0.2个百分点；1-8月固定资产投资增速同比增长20.3%，增速比1-7月份加快0.2个百分点，工业、消费和投资都在提速，继续验证中国经济复苏回暖态势的确立。

综合来看，国际市场中，国际市场有QE、叙利亚和意大利政局三大风险点，但短期应该不会成为较大的导火索，后期需要密切关注。而国内经济数据表现良好，预计市场仍然会有较好的表现。因此投资者可以逢低做多，建议多持。

行情预判：日内交易（基于30分钟图表）盘整—观望

短线波段交易（基于日线图表）：震荡上行—逢低做多

中长线波段交易（基于周线图表）：震荡上行—逢低做多

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

#### 关于9月是否缩减QE的重大事件与时间窗口

8月30日 星期五	美联储FOMC理事杜克离职，关注理事拉斯金及伯南克任职动向
9月4日，星期三	美联储褐皮书在北京时间5日凌晨2点公布
<b>9月6日，星期五</b>	<b>关注新增就业人口20万人\失业率7.4%的临界线</b>
9月9日 星期一	周一白天将是美联储决策者在决议前发表公开言论的最后机会
9月16日，星期一	美联储理事将在FOMC会议召开前举行闭门会议，讨论利率政策
9月17日，星期二	8月CPI，9月NAHB/富国房产市场指数的指引
<b>9月17-18日，星期二-星期三</b>	<b>FOMC会议将连开两天，讨论内容包括更新美联储的经济预期。会后将于北京时间19日、星期四凌晨2点发布会议决议，2点半，伯南克将举行新闻发布会。</b>
美联储9月缩减QE的前提	劳动力市场持续好转，经济数据符合下半年经济回升的预期，通胀稳定在上半年的低水平。

#### 公元2013年08月 癸巳蛇年 股指观点回顾

日	一	二	三	四	五	六
				1	2	3
				空持	多开	
4	5	6	7	8	9	10
	多持	无	多持	多持	多持	
11	12	13	14	15	16	17
	多持	多持	多持	多持	多平	
18	19	20	21	22	23	24
	中性	中性	中性	中性	中性	
25	26	27	28	29	30	31
	中性	中性	空开	空持	空持	

#### 2013年09月 癸巳蛇年 股指观点回顾

日	一	二	三	四	五	六
1	2	3	4	5	6	7
	空持	空持	空持	空持	空持	
8	9	10	11	12	13	14
	空减	多开	多持			
15	16	17	18	19	20	21
22	23	24	25	26	27	28
29	30					

### 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
2013-09-10	2,237.984	1,911	10.71	14.24	2472.6	0.9	-1298	21894	28287	-6393
2013-09-09	2,212.516	1,789	10.61	14.08	2434.8	3.6	2007	22488	29353	-6865
2013-09-06	2,139.993	1,192	10.24	13.61	2355.2	0.5	-473	23218	30733	-7515
2013-09-05	2,122.430	1,058	10.16	13.45	2341.8	-0.2	-1627	22893	30913	-8020
2013-09-04	2,127.618	1,165	10.17	13.49	2342.6	-0.1	-3100	23174	30476	-7302
2013-09-03	2,123.112	1,124	10.15	13.46	2349	1.4	-289	22773	33607	-10834
2013-09-02	2,098.448	1,211	10.03	13.31	2329.2	0.6	1392	23953	34160	-10207
2013/08/28	2,101.301	1,322	10.04	13.32	2322.8	-0.3	-1433	24178	34883	-10705
2013/08/27	2,103.567	1,046	10.06	13.33	2338.4	0.0	-8691	23034	37011	-13977

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
2013-09-10	股指	甲醇	棕榈油	菜籽油	航运	航空运输	园区开发	电子制造	医疗器械	中药
2013-09-09	股指	PTA	菜籽油	PVC	银行	港口	多元金融	医疗服务	医疗器械	生物制品
2013-09-06	白糖	豆粕	黄金	#N/A	园区开发	航运	机场	视听器材	食品加工制造	畜禽养殖
2013-09-05	塑料	甲醇	白银	黄金	林业	传媒	网络服务	公交	多元金融	有色金属
2013-09-04	黄金	强麦	白糖	橡胶	港口	钢铁	元件	酒店	渔业	饲料
2013-09-03	白银	橡胶	螺纹钢	铅	林业	种植业	农业综合	港口	多元金融	机场
2013-09-02	橡胶	豆粕	白糖	黄金	种植业	林业	畜禽养殖	航运	港口	饮料制造
2013-08-28	白银	黄金	焦炭	玻璃	公交	航运	机场	通信设备	计算机设备	环保工程及服务

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%
2013-09-10	股指	白糖	甲醇	白银	菜籽油	黄金	2013-09-10	2.38	2.57	1.17
2013-09-09	白糖	股指	塑料	白银	黄金	菜籽油	2013-09-09	1.53	2.57	0.4
2013-09-06	橡胶	豆粕	股指	铅	黄金	玻璃	2013-09-06	-99.41	4.04	2.13
2013-09-05	橡胶	白银	塑料	玻璃	白糖	铅	2013-09-05	-98.98	2.34	0.61
	3.41%	2.85%	2.85%	-3.97%	-3.05%	-2.68%				

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。

#### **免责声明:**

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>