

2013年06月04日 星期二

每日视点·股指

欲其西，袭其东【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	隔夜受差于预期的美国ISM制造业指数影响，市场对美联储退出宽松政策的担忧减弱，美元遭到抛售，非美货币均大幅上涨。其中，以澳元为代表的商品货币涨势最为喜人，隔夜澳元兑美元大涨逾2%。在日内即将公布澳洲联储利率决议之际，澳元买盘的大量涌现，似乎也预示着澳洲联储今日或将难有动作。	
	上证报	周小川：中国不会竞争性货币贬值 环保部重拳治污 袋式除尘望扩容6倍
国内头条	中证报	习近平今天开启美洲之行
		中国拟造五个一级城市群 地方行政区划调整提速
	股票质押式回购最快6月开闸 专家称盘活市场流动性	
	林毅夫：中国经济增长仍将由投资驱动	
	证券时报	十城5月卖地暴增近4倍 地王频出地价猛涨
		百城住宅均价环比连涨12月 地王频出楼市涨价预期强 话题
北京5月楼市期转现暴增11倍 上周深圳住宅成交量环涨17.7% 北京市限制预售证发放调控房价 未来继续上涨预期仍然较强		
和讯网	欧盟内讧：制裁中国将毁光伏市场	
	十城市5月卖地收入增近4倍 北京现房限价或出台	
网络媒体转载排行	热度指数	热门股市话题
	1	页岩气
	2	医药
	3	奶粉
	4	视频
	5	可穿戴
	6	火电
	7	低血压
	8	职业炒手
	9	交割单
10	股权回购	

✍: 李 斌 (策略研究)

☎: 86-755-82563929

✉: libin719@pingan.com.cn

📄: 期货从业资格:F0271067

图1：月度宏观数据

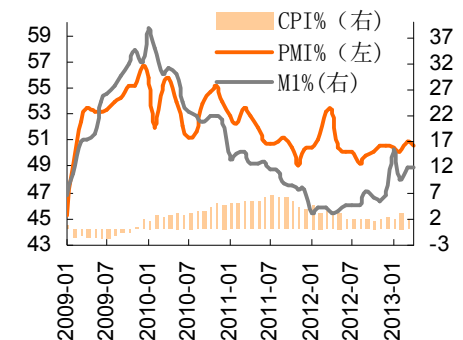
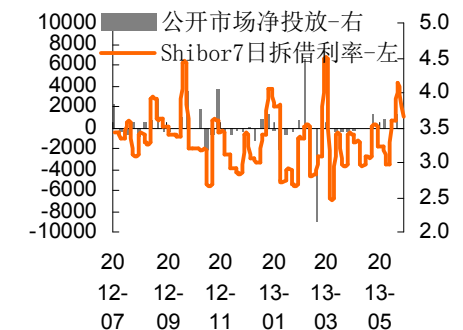


图2：日数据-公开市场及拆借利率



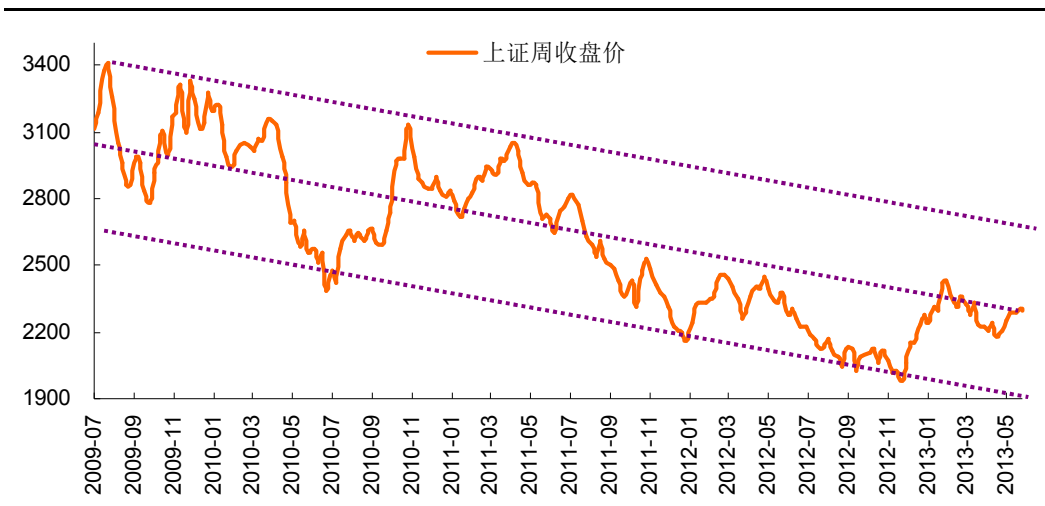
资料来源：平安期货研究所

资料来源：平安期货研究所

二、【单边交易策略】

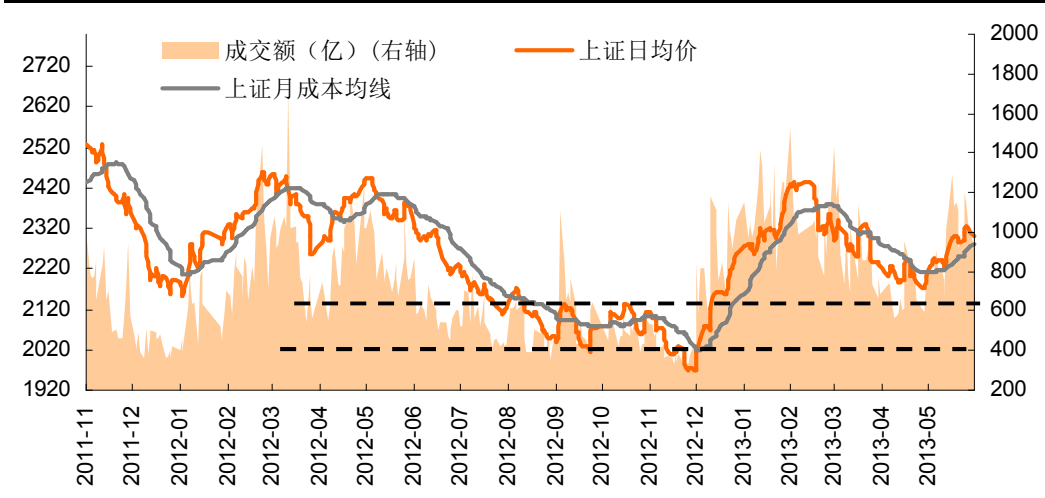
1、波段趋势：周线处于下跌上涨临界、日线级别处于上涨下跌临界

图2-1: 上证周K线图：挑战中轨压力



资料来源: 飞狐、平安期货研究所

图2-2: 上证日K线图：后市视乎大盘与创业板的步伐如何统一



资料来源: 飞狐、平安期货研究所

2、综合论市

国外方面，隔夜美国制造业数据疲弱，令投资人对美联储将很快缩减货币刺激规模的预期降温，及昨日欧洲多国制造业 PMI 向好，亦打压美元，相应地风险资产普遍反弹。当然本周的重点还在于周五出炉的非农数据，这是决定美联储是否在 6 月就缩减 QE 的最关键因素。

国内方面，本周公开市场到期资金合计 2020 亿元，较上周的 300 亿元大增 1720 亿元，创下今年以来最大规模的单周到期资金量。其中包括：6 月 4 日到期 1100 亿元三年期央票和 550 亿元 28 天期正回购操作，6 月 6 日到期 370 亿元 28 天期正回购操作。在到期资金量较大情况下，预计央行今日将适度放水以避免流动性出现更大波动。

综合来看，美国数据的意外萎靡使美联储6月缩减QE的可能性大大减小，风险资产普遍上涨，对今日的市场情绪有所刺激。不过上证指数在近4个交易日连续缩量，而且前期资金最为青睐的创业板指数日MACD转为空头趋势，高位震荡造阶段顶的迹象较为明显，在IPO即将重启的预期下，如果得不到新的热点和资金入场的呼应，不排除沪市与创业板向下寻求一致，因此在深度调整之前，不建议追高做多。操作上，短线可在2600之上以灵活减空与逢高增空配合，中长线交易者可耐心持空单不动。

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）：盘整—空单持有

中长线波段交易（基于周线图表）：盘整—观望。

短线买卖评级：**空持。**

（评级共9档：多开、多持、多减、多平、中性、空开、空持、空减、空平）

三、【重点数据监测】

	收盘价	成交额 (亿)	市盈率 (TTM)	流通市值 (万亿)	1306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
2013-06-03	2,299.252	916	11.36	13.77	2597	-0.3	1134	27009	39209	-12200
2013-05-31	2,300.595	1,007	11.37	13.77	2600	-1.0	-6259	26615	37408	-10793
2013-05-30	2,317.749	1,035	11.45	13.88	2625	-0.1	508	26755	39503	-12748
2013-05-29	2,324.017	1,143	11.48	13.91	2627.2	0.2	-6379	26725	38347	-11622
2013-05-28	2,321.318	1,204	11.48	13.90	2633.2	1.8	4573	29477	41557	-12080
2013-05-27	2,293.077	999	11.33	13.72	2573.6	-0.4	-356	28625	41247	-12622
2013-05-22	2,302.403	1,153	11.39	13.77	2602	0.0	64	29057	46047	-16990
2013-05-21	2,305.114	1,130	11.40	13.79	2599.6	0.0	3023	30250	45954	-15704

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
2013-06-03	豆粕	菜籽油	黄金	白银	环保工程 服务	燃气	化学纤维	环保工程 服务	医疗器械	水务
2013-05-31	豆粕	菜籽油	玻璃	焦炭	环保工程 服务	医药商业	动物保健	农业综合	医疗器械	燃气
2013-05-30	黄金	白银	玻璃	橡胶	物流	医疗服务	医疗器械	饲料	其他采掘	燃气
2013-05-29	豆粕	菜籽油	白糖	橡胶	餐饮	汽车整车	其他电子	保险	证券	通信运营
2013-05-28	白糖	棕榈油	焦炭	螺纹钢	酒店	证券	房地产开发	电子制造	医疗服务	网络服务
2013-05-27	白银	菜籽油	焦炭	螺纹钢	医疗器械	采掘服务	农业综合	煤炭开采	视听器材	航运
2013-05-22	塑料	豆油	早籼稻	#N/A	农业综合	汽车整车	林业	电子制造	光学光电 子	半导体
2013-05-21	白银	黄金	白糖	螺纹钢	电子制造	计算机设备	水务	食品加工制 造	银行	保险

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%
2013-06-03	豆粕 7.40%	菜籽油 4.64%	铝 2.69%	焦炭 -4.78%	橡胶 -4.15%	玻璃 -3.94%	2013-06-03	-0.3	-1.77	-0.39
2013-05-31	豆粕 3.50%	菜籽油 3.18%	黄金 2.27%	焦炭 -7.55%	橡胶 -5.98%	螺纹钢 -5.95%	2013-05-31	-1.22	-0.98	0.55
2013-05-30	豆粕 2.23%	菜籽油 2.01%	棕榈油 1.63%	橡胶 -6.02%	焦炭 -5.38%	螺纹钢 -5.31%	2013-05-30	0.2	-0.8	0.6
2013-05-29	白银 4.34%	塑料 3.48%	黄金 3.41%	螺纹钢 -5.07%	橡胶 -4.34%	焦炭 -4.12%	2013-05-29	0.4	-1.03	0.03

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>