

金融期货日评

品种聚焦●股指期货

信息截止至 2011 年 11 月 10 日 17:30 [返回顶端](#)

股指期货

欧债危机利空 A 股，2700 勉力支撑期价

投资策略

中期策略

技术指标及国内外宏观经济状况和财政状况均展现利好，股指进入反弹周期，可期待中期行情出现。

短期策略

指数未能摆脱欧债危机利空影响，资金恐慌性流出，调整面临延长。上证考验 60 日均线 and 2450 支撑，日内短线操作等待做多时机。

市场综述

意大利 10 年期国债收益率飙升利空 A 股，股指主力合约低开于 10 日均线之下，日内冲高回落，午后震荡收阴，日内跌幅 1.62%。k 线形态几乎光脚，下方沉重，调整或还将延续。

沪深两市成交量能略有增加，市场情绪略有恐慌。上证指数回撤至 60 日均线，而深成指收到 5、10 均线联合压制，延续调整形态。保险、水泥、有色金属等板块跌幅较深，券商板块资金流出最多。题材股的黯淡预示市场若要反弹还需积累量能。

基本面信息

沪深 A 股共成交 1736.65 亿元，沪市 A 股成交 852.91 亿元，深市 A 股(包含中小企板)成交 671.03 亿元，创业板成交 212.72 亿元，A 股成交中，资金流入性成交 780.40 亿元，资金流出性成交-889.80 亿元，不确定性成交 66.46 亿元，流入流出成交差额-109.40 亿元，占大盘全部成交 6.18%。(和讯资金流向)

上海银行间同业拆放利率短期利率下滑企稳，短期资金面开始承压，中长期利率维持高位，压制股指升势。

中央银行第八十七期票据期限 3 个月(91 天)，发行量 20 亿元，缴款日为 2011 年 11 月 11 日。

新华社撰文：政策见底意味 A 股最坏期已过藏巨大机会。伴随“一顶双底”预期日渐强烈，近期 A 股市场情绪明显趋于乐观。A 股反弹或反转，仍有待中长期经济信号和政策信号的确认。

周四欧市早盘，欧洲股市开盘重挫，不过美指反而有所承压，风险货币有低位企稳迹象。英国央行将公布利率决议，时段内，加拿大将公布 9 月贸易帐；而美国晚

金融分析师

张雷

电话：

0516-83831139

执业证编号：

F0264563

电子邮件：

zhanglei@neweraqh.com.cn

间也将公布 9 月贸易帐，预计这些经济数据将会给汇市走势带来更多的交投线索。

技术分析



点评：从15分钟主力情况来看，主力线反弹夭折，潮起潮落指标再次打到低位。市场反应较弱。等待盘中反弹机会。

持仓分析

多头持仓排行				空头持仓排行		
会员简称	多仓	增减	名次	会员简称	空仓	增减
国泰君安	3505	173	1	中证期货	6523	-356
浙江永安	3177	486	2	国泰君安	4908	-221
华泰长城	2473	-350	3	海通期货	3767	97
光大期货	2251	498	4	华泰长城	3712	-167
海通期货	1779	-625	5	广发期货	2753	115
南华期货	1724	-121	6	中粮期货	2088	-285
广发期货	1371	-494	7	光大期货	1927	-594
申银万国	1285	-129	8	中信建投	1130	38
银河期货	1261	-257	9	兴业期货	1112	71
中证期货	1122	-614	10	南华期货	1032	30
国信期货	1004	1004	11	申银万国	942	44
上海东证	992	369	12	招商期货	893	-29
浙商期货	974	-32	13	上海东证	840	-135
招商期货	954	-132	14	银河期货	826	-101
鲁证期货	904	-430	15	鲁证期货	644	65
金瑞期货	851	630	16	安信期货	607	-754
信达期货	849	-205	17	浙江永安	574	-101
安信期货	772	29	18	天琪期货	561	77
格林期货	660	-44	19	大华期货	378	-417
天琪期货	592	592	20	长江期货	347	347
江苏弘业	274	6	21	中钢期货	317	50
东吴期货	239	-18	22	国信期货	218	-572
冠通期货	219	219	23	中国国际	164	48
			24	国都期货	143	6
	29232	555	合计		36406	-2744

点评：从右图 IF 总持仓来看，市场空方依然占据优势，但持仓差距在缩小。市场短空情绪有所缓解，股指视为回调，等待做多机会。

免责声明

本报告的信息来源于已公开的资料，我们力求但不保证这些信息的准确性、完整性或可靠性。报告内容仅供参考，报告中的信息或所表达观点不构成期货交易依据，新纪元期货有限公司不对因使用本报告的内容而引致的损失承担任何责任。投资者不应将本报告为作出投资决策的惟一参考因素，亦不应认为本报告可以取代自己的判断。在决定投资前，如有需要，投资者务必向咨询期货研究员并谨慎决策。

本报告旨在发送给新纪元期货有限公司的特定客户及其他专业人士。报告版权仅为新纪元期货有限公司所有，未经书面许可，任何机构和个人不得以任何形式翻版、复制和发布。如引用发布，需注明出处为新纪元期货有限公司研究所，且不得对本报告进行有悖原意的引用、删节和修改。

新纪元期货有限公司对于本免责声明条款具有修改权和最终解释权。

联系我们

总部

地址：江苏省徐州市淮海东路153号新纪元期货大厦

电话：0516-83831105 83831109

北京东四十条营业部

地址：北京市东城区东四十条68号平安发展大厦407室

电话：010-84261653

南京营业部

地址：南京市北门桥路10号04栋3楼

电话：025-84787997 84787998 84787999

广州营业部

地址：广州市越秀区东风东路703号粤剧院文化大楼11层

电话：020-87750882 87750827 87750826

苏州营业部

地址：苏州园区苏华路2号国际大厦六层

电话：0512-69560998 69560988

常州营业部

地址：江苏省常州市武进区延政中路2号世贸中心B栋2008

电话：0519-88059972 0519-88059978

杭州营业部

地址：浙江省杭州市上城区江城路889号香榭商务大厦7-E、F

电话：0571-56282606 0571-56282608

上海浦东南路营业部

地址：上海市浦东新区浦东南路256号1905室

电话：021-61017393

重庆营业部

地址：重庆市江北区西环路8号B幢8-2、8-3、8-3A号房

电话：023-67900698 023-67109158

全国统一客服热线：0516-83831105 83831109

欢迎访问我们的网站：<http://www.neweraqh.com.cn>