



11月14日

持仓略增

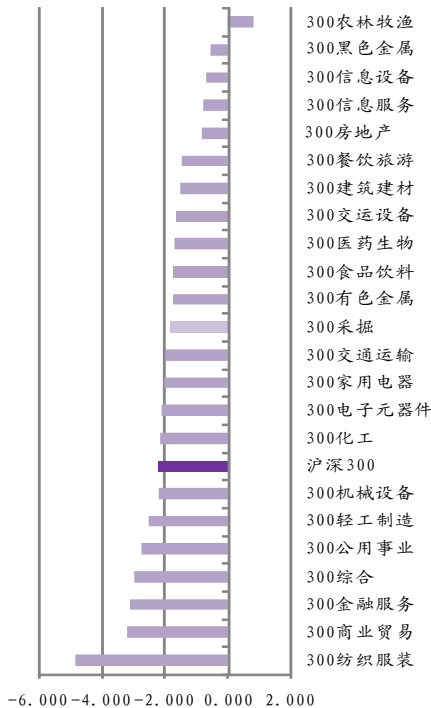
前十交易席位增多

图表 1: 全球股市概览:

股市	指数	涨跌	比例
道琼工业	15821.63	70.96	0.45%
NASDAQ	3965.58	45.66	1.16%
S&P 500	1782	14.31	0.81%
罗素 2000	1112.18	10.71	0.97%
德国股市	9054.83	-21.65	-0.24%
日经 225	14567.16	-21.52	-0.15%
CBOE 黄金	99.8	0.59	0.59%
香港恒生	22463.83	-437.58	-1.91%
香港国企	10276.61	-285	-2.70%

数据来源: StockQ 网站(11月14日更新)

图表 2: 沪深 300 指数日板块表现:



数据来源: 同花顺(11月14日更新)

撰写: 光大期货研究所 任静雯

职业资格号: F0295415

电话: 021-22169060-316

QQ: 1610634056

E-mail: renjw@ebfcn.com.cn

## 今日要闻

- 国资委: 推动制订国资国企改革路线图(中证报)
- 300吨以下油墨项目将逐步关停(中证报)
- 商务部: 正研究建立商贸物流标准体系(证券时报)
- 加大改革推进力度 确保已部署重点任务显实效--国务院(路透)
- 中国10月财政支出提速增逾20% 年底突击花钱隐忧再现(路透)
- 中石油限气范围扩大多家化工企业将停产减产(万德)
- 全面深化改革决定可能1周内发布;安徽试点流转农村集体建设用地, 将建土地交易市场(财联社)

## 市场回顾

昨日沪深 300 指数收跌 51.88 点或 2.22%，中小板指收跌 1.73%，创业板指收跌 1.32%。两市成交量较前一日增 3.57%。日内涨停股 10 只，跌停个股 7 只。嘉实沪深 300ETF(159919)收跌 1.8%，华泰柏瑞沪深 300ETF(510300)收跌 1.89%。

## 光大视点

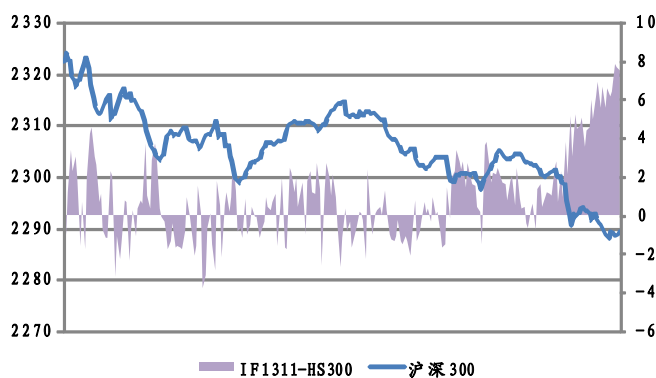
昨日股指期货持仓量增加 6.66%，交易量减少 1.72%，昨日 12 月合约增仓较为显著，前 20 交易席位多单较前一日增 37.4%，空单较前一日增 35.6%。昨日当月 11 月合约价差区间在 -4 至 8 点，12 月合约价差区间在 -6 至 4 点，1403 合约价差区间在 2 至 11 点，1406 合约价差区间在 2 点至 12 点。本周开始流通市值约为 318 亿元，与上周相比有所回落，解禁压力主要来自于中小板。央行货币政策报告释放从紧信号，至年底，流动性将不会有很大改善，政策方面，三中全会后相关主题或有一定的炒作空间。我们认为市场已经充分反映经济增速的下行与流动性的偏紧预期，指数继续下行空间有限，风格切换或给市场注入新的活力。

图表 3: 持仓占比分析

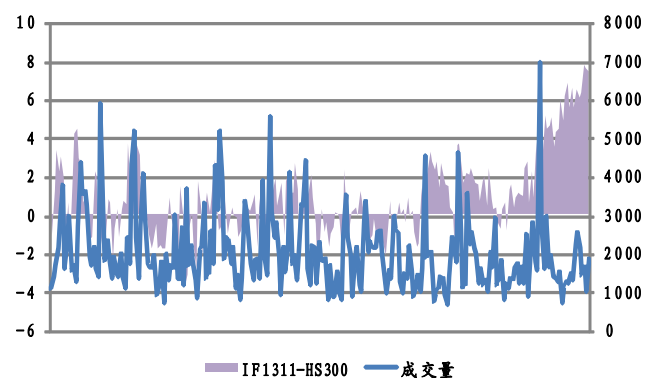
11月13日							
1311 合约	持买单量	持买单占比	买单变化率	持卖单量	持卖单占比	卖单变化率	多空占比差
1-5 名	11803	28.53%	-21.5%	19063	46.08%	-18.1%	17.55%
6-10 名	7490	18.11%	-15.4%	7240	17.50%	-21.7%	-0.60%
11-15 名	5840	14.12%	-20.1%	5176	12.51%	-9.4%	-1.61%
16-20 名	4383	10.59%	-25.9%	3232	7.81%	-18.9%	-2.78%
1-10 名	19293	46.64%	-19.2%	26303	63.58%	-19.1%	16.95%
11-20 名	10223	24.71%	-22.7%	8408	20.32%	-13.3%	-4.39%
<b>前 20 名</b>	<b>29516</b>	<b>71.35%</b>	<b>-20.5%</b>	<b>34711</b>	<b>83.91%</b>	<b>-17.8%</b>	<b>12.56%</b>
1312 合约	持买单量	持买单占比	买单变化率	持卖单量	持卖单占比	卖单变化率	多空占比差
1-5 名	20027	32.76%	39.5%	28956	47.36%	33.1%	14.60%
6-10 名	10996	17.98%	33.0%	9723	15.90%	37.7%	-2.08%
11-15 名	7761	12.69%	43.4%	6443	10.54%	49.3%	-2.16%
16-20 名	5435	8.89%	31.2%	3788	6.20%	28.4%	-2.69%
1-10 名	31023	50.74%	37.1%	38679	63.26%	34.3%	12.52%
11-20 名	13196	21.58%	38.1%	10231	16.73%	40.8%	-4.85%
<b>前 20 名</b>	<b>44219</b>	<b>72.32%</b>	<b>37.4%</b>	<b>48910</b>	<b>80.00%</b>	<b>35.6%</b>	<b>7.67%</b>
1311+1312	持买单量	持买单占比	买单变化率	持卖单量	持卖单占比	卖单变化率	多空占比差
1-5 名	31830	31.05%	8.3%	48019	46.84%	6.6%	15.79%
6-10 名	18486	18.03%	8.0%	16963	16.55%	4.0%	-1.49%
11-15 名	13601	13.27%	6.9%	11619	11.33%	15.9%	-1.93%
16-20 名	9818	9.58%	-2.4%	7020	6.85%	1.2%	-2.73%
1-10 名	50316	49.08%	8.2%	64982	63.39%	5.9%	14.31%
11-20 名	23419	22.85%	2.8%	18639	18.18%	9.9%	-4.66%
<b>前 20 名</b>	<b>73735</b>	<b>71.93%</b>	<b>6.4%</b>	<b>83621</b>	<b>81.57%</b>	<b>6.8%</b>	<b>9.64%</b>

数据来源: 光大期货研究所 (注: 多-空占比差为所指合约持买单量占比与所指合约持卖单量占比之差) (更新时间: 2013 年 11 月 13 日)

图表 4: IF1311 价格及价差变化图

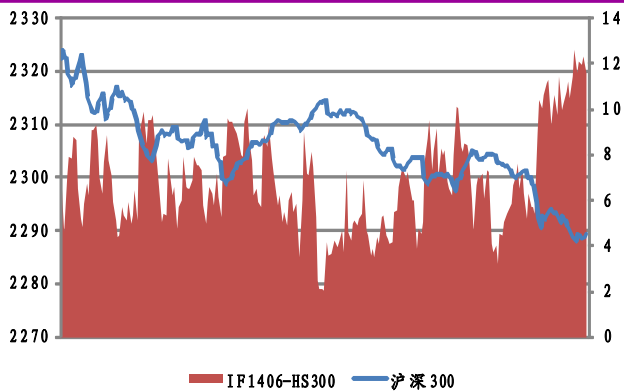


图表 5: IF1311 价格及成交量变化图

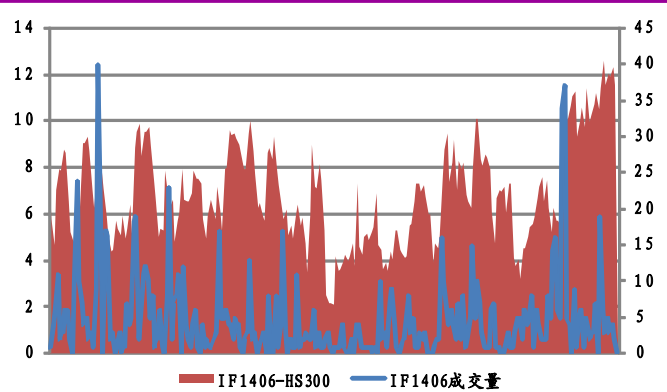


资料来源: 同花顺光大期货研究所 (更新时间: 2013 年 11 月 13 日)

图表 6: IF1406 价格及价差变化图

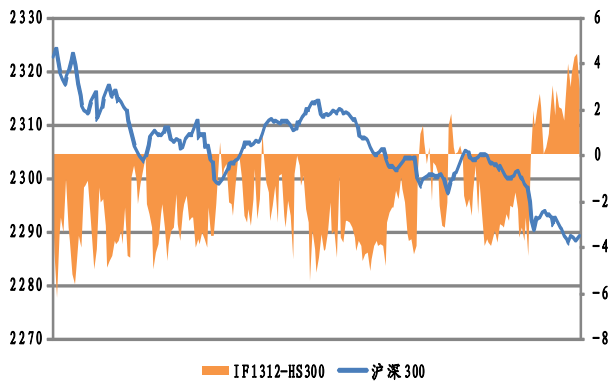


图表 7: IF1406 价格及成交量变化图

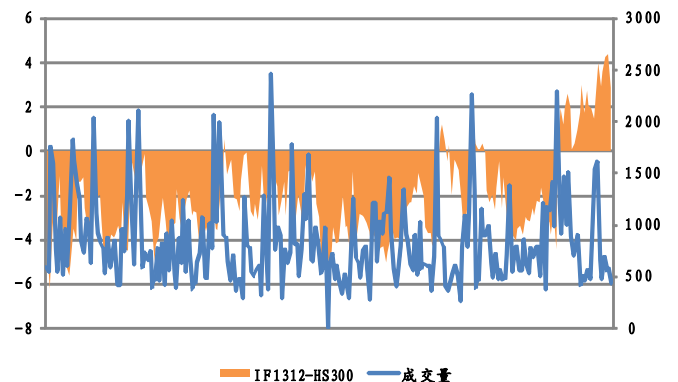


资料来源: 同花顺光大期货研究所 (更新时间: 2013 年 11 月 12 日)

图表 8: IF1312 价格及价差变化图

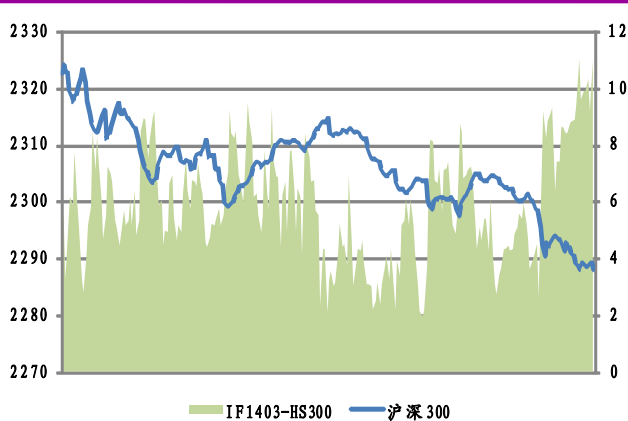


图表 9: IF1312 价格及成交量变化图

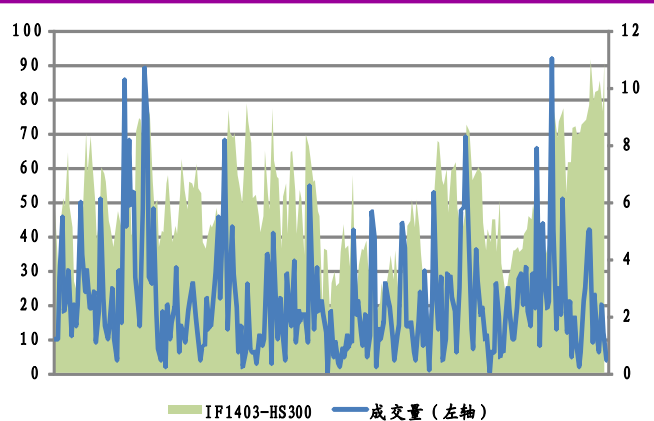


资料来源: 同花顺光大期货研究所 (更新时间: 2013 年 11 月 13 日)

图表 10: IF1403 价格及价差变化图

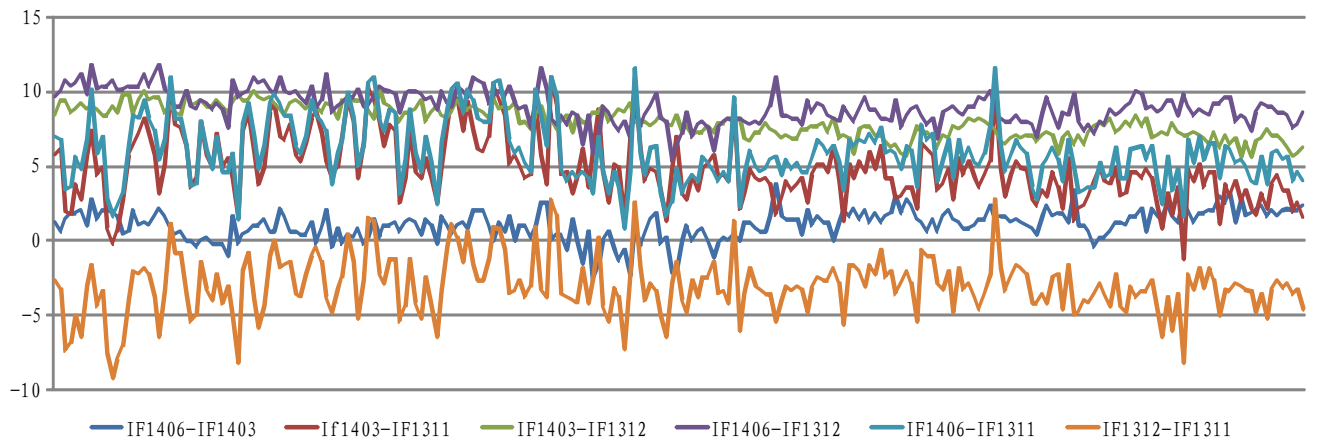


图表 11: IF1403 价格及成交量变化图



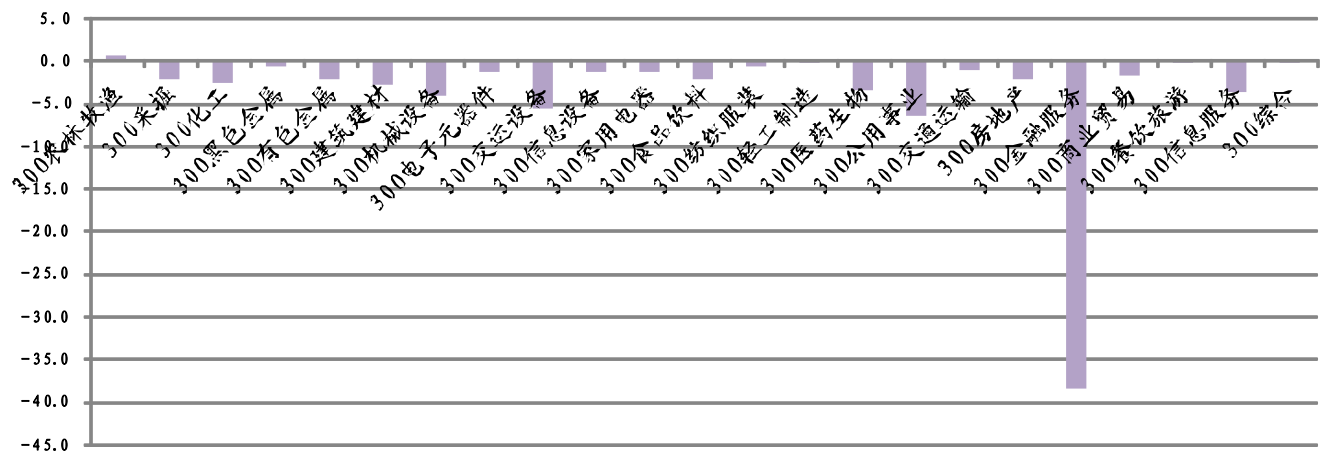
资料来源: 同花顺光大期货研究所 (更新时间: 2013 年 11 月 13 日)

图表 10: IF1307 价格及价差变化图



资料来源: 同花顺光大期货研究所 (更新时间: 2013 年 11 月 13 日)

图表 11: 日沪深 300 各板块资金流向



资料来源: 同花顺光大期货研究所 (更新时间: 2013 年 11 月 13 日)

#### 免责声明

本报告的信息均来源于公开资料, 我公司对这些信息的准确性和完整性不作任何保证, 也不保证所包含的信息和建议不会发生任何变更。我们已力求报告内容的客观、公正, 但文中的观点、结论和建议仅供参考, 报告中的信息或意见并不构成所述品种的操作依据, 投资者据此做出的任何投资决策与本公司和作者无关。