



5月29日

光大视点

主题搭台，权重唱戏

短期或有支撑

昨日沪深300指数收涨22点或1.03%，两市成交量较前一交易日增加23%。创业板指收涨2.5%，中小板指收涨1.69%。两市跌停个股2只，涨停个股22只。股指期货持仓量增加3.9%，交易量增加41.8%。多空占比差较前一日回落，前20席位多单增持较为明显。PMI回暖因素刺激股市上行的效果或将慢慢减退，前期利空因素没有实质性的变化，IPO开闸或加速，后续仍需观察地产链数据的变化，近期场内情绪有所回暖，短期或有一定反弹动力。

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

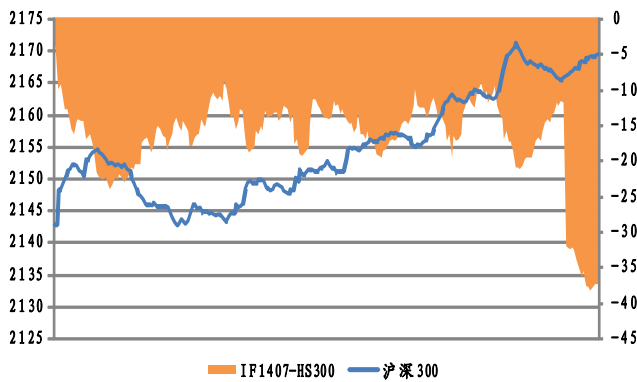
E-mail: renjw@ebfcn.com.cn

图表 3: 持仓占比分析

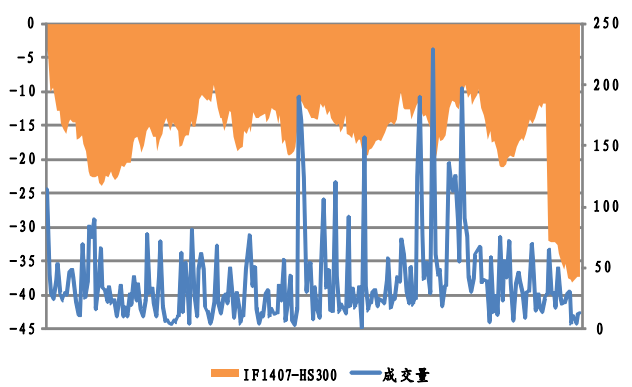
5月27日							
1406 合约	持买单量	持买单占比	买单变化率	持卖单量	持卖单占比	卖单变化率	多空占比差
1-5 名	32785	29.63%	2.2%	48403	43.75%	-2.5%	14.12%
6-10 名	17840	16.12%	9.3%	17815	16.10%	6.5%	-0.02%
11-15 名	12699	11.48%	10.0%	10213	9.23%	12.4%	-2.25%
16-20 名	9039	8.17%	9.6%	8550	7.73%	10.5%	-0.44%
1-10 名	50625	45.75%	4.6%	66218	59.85%	-0.3%	14.09%
11-20 名	21738	19.65%	9.8%	18763	16.96%	11.5%	-2.69%
<b>前 20 名</b>	<b>72363</b>	<b>65.40%</b>	<b>6.1%</b>	<b>84981</b>	<b>76.80%</b>	<b>2.1%</b>	<b>11.40%</b>
1407 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	5496	47.29%	3.4%	8459	72.78%	14.1%	25.49%
6-10 名	2521	21.69%	28.2%	1662	14.30%	0.7%	-7.39%
11-15 名	1131	9.73%	9.6%	677	5.83%	2.6%	-3.91%
16-20 名	652	5.61%	12.6%	293	2.52%	8.9%	-3.09%
1-10 名	8017	68.98%	10.1%	10121	87.08%	11.6%	18.10%
11-20 名	1783	15.34%	10.7%	970	8.35%	4.4%	-7.00%
<b>前 20 名</b>	<b>9800</b>	<b>84.32%</b>	<b>10.2%</b>	<b>11091</b>	<b>95.43%</b>	<b>11.0%</b>	<b>11.11%</b>
1409 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	13108	35.64%	4.5%	25096	68.23%	0.8%	32.59%
6-10 名	5723	15.56%	15.1%	4778	12.99%	5.5%	-2.57%
11-15 名	4129	11.23%	3.4%	2012	5.47%	2.2%	-5.76%
16-20 名	3165	8.60%	4.8%	1518	4.13%	3.3%	-4.48%
1-10 名	18831	51.19%	7.5%	29874	81.22%	1.6%	30.02%
11-20 名	7294	19.83%	4.0%	3530	9.60%	2.6%	-10.23%
<b>前 20 名</b>	<b>26125</b>	<b>71.02%</b>	<b>6.5%</b>	<b>33404</b>	<b>90.81%</b>	<b>1.7%</b>	<b>19.79%</b>
1406+1407+1409	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	45893	31.13%	2.8%	73499	49.85%	-1.4%	18.72%
6-10 名	23563	15.98%	10.7%	22593	15.32%	6.3%	-0.66%
11-15 名	16828	11.41%	8.3%	12225	8.29%	10.6%	-3.12%
16-20 名	12204	8.28%	8.3%	10068	6.83%	9.3%	-1.45%
1-10 名	69456	47.11%	5.4%	96092	65.18%	0.3%	18.07%
11-20 名	29032	19.69%	8.3%	22293	15.12%	10.0%	-4.57%
<b>前 20 名</b>	<b>98488</b>	<b>66.80%</b>	<b>6.2%</b>	<b>118385</b>	<b>80.30%</b>	<b>2.0%</b>	<b>13.50%</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: 2014 年 5 月 28 日

图表 4: IF1407 价格及价差变化图

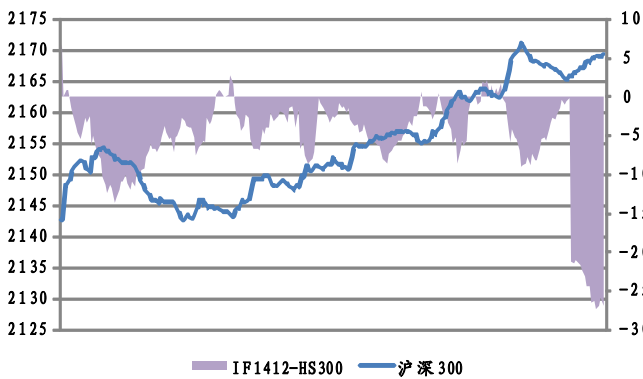


图表 5: IF1407 价差及成交量变化图

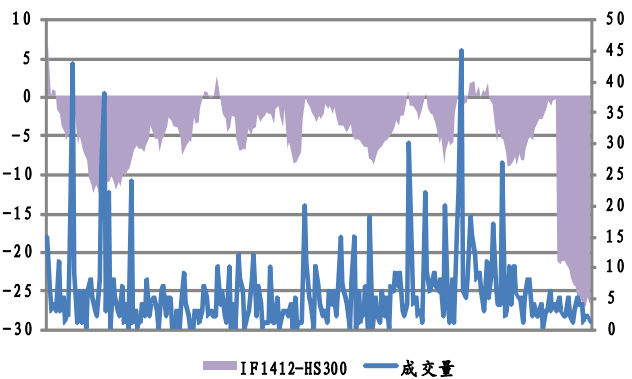


资料来源: 同花顺光大期货研究所 (更新时间: 2014 年 5 月 28 日)

图表 6: IF1412 价格及价差变化图

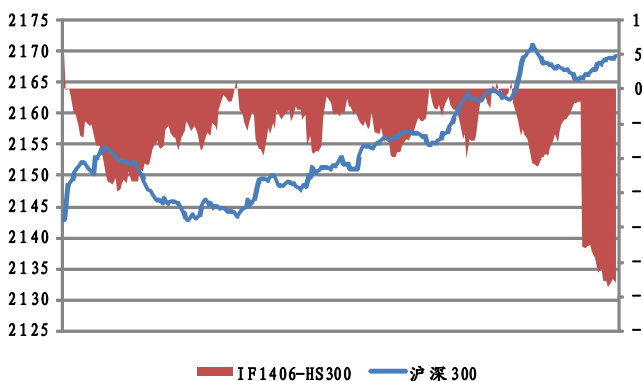


图表 7: IF1412 价差及成交量变化图

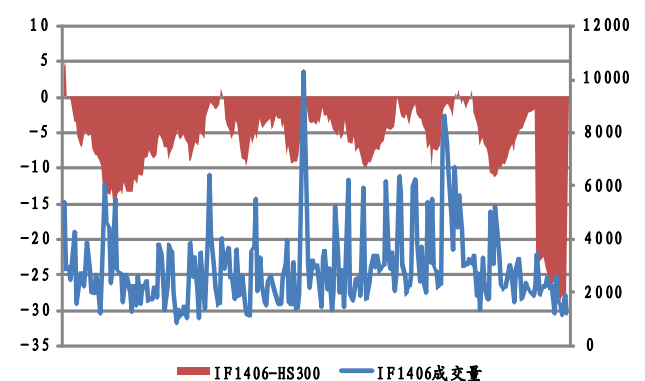


资料来源: 同花顺光大期货研究所 (更新时间: 2014 年 5 月 28 日)

图表 8: IF1406 价格及价差变化图

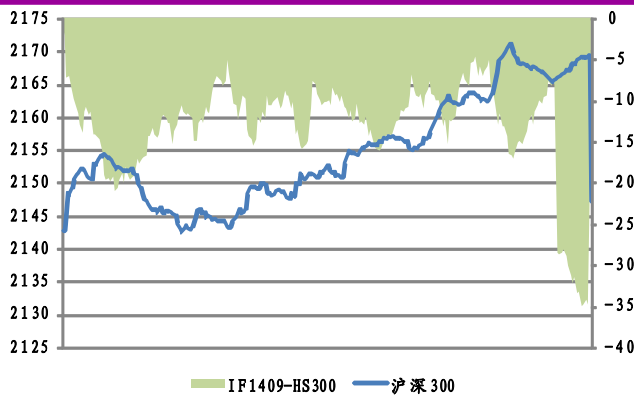


图表 9: IF1406 价差及成交量变化图

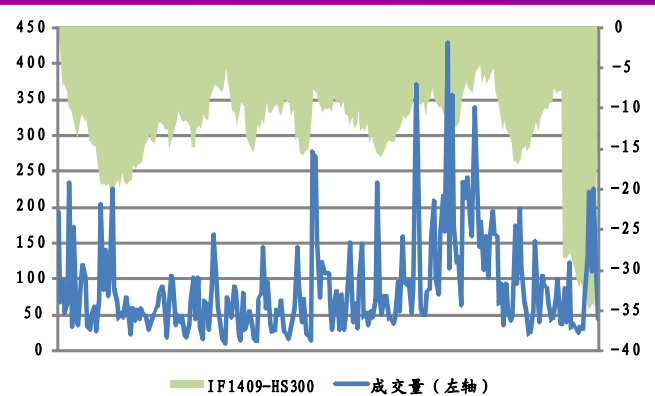


资料来源: 同花顺光大期货研究所 (更新时间: 2014 年 5 月 28 日)

图表 10: IF1409 价格及价差变化图

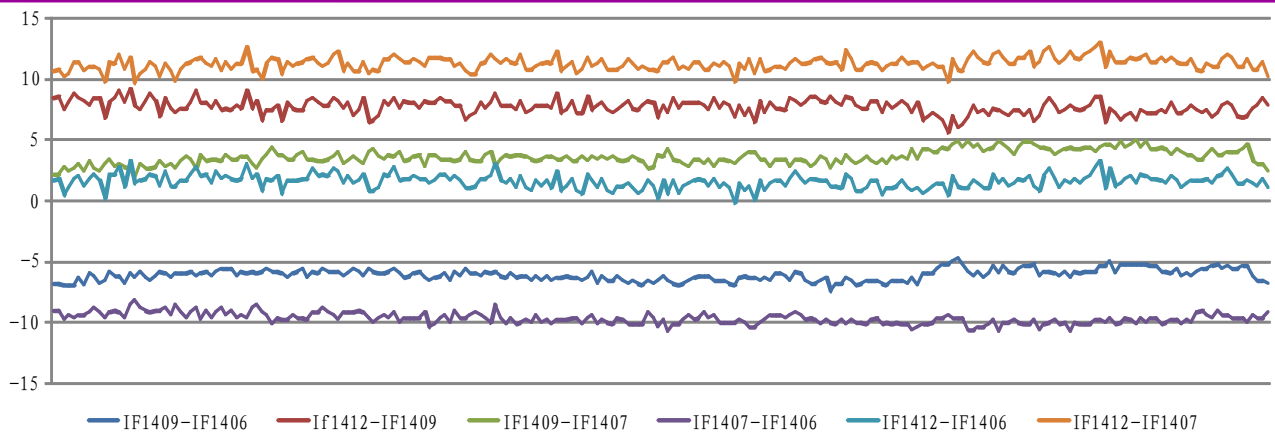


图表 11: IF1409 价差及成交量变化图



资料来源: 同花顺光大期货研究所 (更新时间: 2014 年 5 月 28 日)

图表 10: 各月合约价差变化图



资料来源: 同花顺光大期货研究所 (更新时间: 2014 年 5 月 28 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。