

# 东方晨报

2013. 9. 03



## 【市场回顾】

### 一、国内市场

#### ➤ 股票市场

周一（9月2日），9月份第一个交易日，A股早盘高开后在光大证券、贵州茅台跌停的拖累下一度快速跳水，之后随着农业股、汽车股、互联网科技股的走强，股指走势趋于平稳，上证综指午后曾重返2100点之上。不过，由于经济复苏短期还无法证伪，外围市场搅扰，A股市场走势谨慎，震荡格局暂时难以改变。截止收盘，上证综指涨0.07点报2098.45点，深证成指涨41.10点或0.50%报8243.58点。两市全天成交额约2159亿元人民币，上日同期为2569亿人民币。中小板指收盘涨1.53%，创业板指收盘涨2.11%。

#### ➤ 股指期货

沪深300股指期货主力合约IF1309收盘涨1.17%，报2329.2点，升水8.86点。全天成交81.07万手，持仓7.89万手，增仓1392手。现货方面，沪深300指数收盘涨0.28%，报2320.34点。

#### ➤ 货币市场

香港万得通讯社报道，周一（9月2日）上海银行间同业拆放利率具体情况如下：

| 证券简称     | 期限  | 当天利率(%) | 涨跌基点   |
|----------|-----|---------|--------|
| SHIBOR隔夜 | O/N | 3.0188  | -1.52  |
| SHIBOR1周 | 1W  | 3.7420  | 0.65   |
| SHIBOR2周 | 2W  | 4.15    | -16.10 |
| SHIBOR1月 | 1M  | 4.60    | -20.50 |
| SHIBOR3月 | 3M  | 4.6561  | -0.11  |
| SHIBOR6月 | 6M  | 4.2198  | 0      |
| SHIBOR9月 | 9M  | 4.2701  | 0      |
| SHIBOR1年 | 1Y  | 4.40    | 0      |

周一（9月2日），上海银行间同业拆放利率（Shibor）多数下跌。具体来看，1周品种涨0.65个基点，报3.7420%；隔夜品种跌1.52个基点，报3.0188%；1个月品种跌20.5个基点，报4.60%。

### 二、国际市场

#### ➤ 股票市场

周一（9月2日），全球主要股指多数收高，欧股和亚太股市多数上涨，美国休市。其中，韩国和希腊股指小幅下跌，中国台湾股指小幅上涨，其余国家股指涨幅均超1%，法国股指涨1.84%，收于4000点上方。

美国方面：休市

欧洲方面：当日欧洲主要股指多数上涨，仅希腊股指微跌0.08%，法国股指涨1.84%。截至收盘，欧股风向标泛欧斯托克600指数涨1.9%，收报302.94点。德国DAX指数涨140.72点或1.74%，报8243.87点。英国富时100指数涨93.26点或1.45%，报6506.19点。法国

CAC40 指数涨 72.23 点或 1.84%，报 4006.01 点。此外，西班牙 IBEX 35 指数报 8429.6 点，涨 139.1 点或 1.68%。意大利指数报 18064 点，涨 309.22 点或 1.74%。希腊 ASE 通用指数报 899.19 点，跌 0.73 点或 0.08%。

亚太方面：亚太主要股指收盘普遍收高，惟韩国股指收低。日经 225 指数收报 13572.92 点，上涨 184.06 点或 1.37%。韩国综合指数收报 1924.81 点，下跌 1.55 点或 0.08%。澳洲标普 200 指数收报 5188.30 点，上涨 53.34 点或 1.04%。新西兰 NZ50 指数收报 4596.36 点，上涨 55.39 点或 1.22%。中国台湾加权指数收报 8038.86 点，上涨 16.97 点或 0.21%。

## ➤ 大宗商品

黄金：周一（9 月 2 日），上期所贵金属期货夜盘交易收盘涨幅互现，黄金跌 0.22%，白银涨 2.87%。主要由于美国对叙利亚军事行动近期或搁浅，美国国会尚未就奥巴马对叙利亚动武提议进行表决，且北约 12 国拒绝出兵叙利亚，金价继续回落。当日夜盘，黄金期货主力合约收跌 0.22%，报 277.55 元/克，盘中最高价 278.9 元/克，最低价 277.2 元/克；白银主力合约收报 4907 元/千克，涨幅为 2.87%，盘中最高价 4919 元/千克，最低价 4858 元/千克。

## 【热点资讯】

### 【中金所：国债期货上市首日涨跌停板幅度为±4%】

中国金融期货交易所 9 月 2 日发布通知明确，5 年期国债期货各合约的交易保证金暂定为合约价值的 3%，交割月份前一个月中旬的前一交易日结算时起，交易保证金暂定为合约价值的 4%，交割月份前一个月下旬的前一交易日结算时起，交易保证金暂定为合约价值的 5%。上市首日各合约的涨跌停板幅度为挂盘基准价的±4%。

这份通知名为《关于 5 年期国债期货合约上市交易有关事项的通知》。该通知明确，5 年期国债期货首批上市合约为 2013 年 12 月 (TF1312)、2014 年 3 月 (TF1403) 和 2014 年 6 月 (TF1406)。各合约挂盘基准价由交易所在合约上市交易前一交易日公布。

5 年期国债期货各合约的可交割国债和转换因子由交易所在合约上市交易前公布。

通知还表明，5 年期国债期货合约的手续费标准暂定为每手 3 元，交割手续费标准为每手 5 元。交易所所有权根据市场运行情况对手续费标准进行调整。5 年期国债期货合约上市交易其他事项另行公布。

### 【原博时基金经理马乐因涉老鼠仓被批准逮捕】

从深圳市人民检察院了解到，近日，该院以涉嫌利用未公开信息交易罪批准逮捕犯罪嫌疑人原博时基金经理马乐。

马乐在接受讯问时供称，自己利用控制的 3 个证券账户，先于基金账户买入，基金账户再买；先于基金账户卖出，基金账户再卖，使控制的账户获得稳定的较高收益。据查，该 3 个证券账户开户人为马乐妻子的亲戚或同学，但账户均由马乐操作，密码也由他掌管。

办案检察官郭嘉指出，犯罪嫌疑人马乐作为基金管理公司的从业人员，利用因职务便利获取的内幕信息以外的其他未公开的信息，从事与该信息相关的证券交易，情节特别严重，其行为已触犯了刑法第一百八十条之规定，涉嫌利用未公开信息交易罪。

侦查机关初步查明，2011年3月9日至2013年5月30日，犯罪嫌疑人马乐在担任“博时精选”基金经理期间，利用“博时精选”交易股票的非公开信息，操作自己控制的3个股票账户，通过临时购买的不记名神州行卡电话下单，先于或同期于其管理的“博时精选”基金买入相同股票76只，成交金额10亿余元，获利近2000万元。

### 【习近平将发表演讲阐述新一届政府外交政策】

在9月2日的例行新闻发布会上，外交部新闻发言人洪磊表示，习近平主席访问包括哈萨克斯坦在内的中亚四国期间，将与各国元首举行正式会谈，分别会见各国总理、议长等主要领导人，并共同签署联合宣言等政治和合作文件。习近平主席将与中亚各国领导人就深化双边关系、推动各领域互利合作等问题深入交换意见，提出新的合作建议，全面提升中国与中亚各国双边关系水平。双方还将就共同关心的重大国际和地区热点问题深入交换意见，协调立场。习近平主席还将在哈萨克斯坦发表演讲，系统阐述中国新一届政府对中亚的外交政策。

### 【8月汇丰中国制造业PMI终值为50.1创4个月新高】

汇丰9月2日公布，经季节性调整的汇丰中国采购经理人指数（PMI）8月份数值录得50.1，显示制造业运行相对趋稳。指数从7月份的11个月低点（47.7）回升，创四个月高点并结束了此前连续3个月的放缓状态。

8月份，制造业产出随市况好转而出现扩张，为3个月以来首见。不过，扩张率仅算轻微。支撑产出扩张的是新订单总量的增长，虽然增幅轻微，但在4月份以来尚属首见。另一方面，新出口订单连续第五个月收缩，而且收缩率环比略有加速。调查显示，欧美客户需求疲弱，导致最近新接出口业务减少。

在新接业务量增加的背景下，积压工作量创下两年来最大增速，近一成受访厂商的未完成工作量上升。与此同时，用工数量连续第五个月收缩，但收缩率轻微，为4个月以来最小。平均投入成本上扬，为今年2月以来首见，但涨幅尚小，低于调查历史平均值。成本上扬的原因普遍与原料涨价有关。

成本的上扬，一定程度上被传导至客户。8月份，制造业产品平均出厂价格虽仅有轻微涨幅，但已是6个月以来首见。采购活动出现小幅扩张，为4月份以来首见。调查显示，生产需求随新订单增长而上升，厂商因此增加采购。采购库存连续7个月下降，8月份降幅温和。成品库存连续第2个月下降，但降幅轻微。在最近调查期间，销售超出预期，导致库存下降。

### 【外交部：政治解决是叙利亚问题唯一现实出路】

在9月2日的例行新闻发布会上，外交部新闻发言人洪磊表示，中方注意到关于美方公布证据的报道。美方也向中方介绍了相关情况。中方反对任何人使用化学武器，支持联合国进行独立、公正、客观、专业的调查。

他指出，中方一直关注叙利亚局势，始终认为政治解决是叙利亚问题的唯一现实出路。中国对有关国家可能采取单边军事行动表示严重关切。国际社会采取的任何行动都应遵守《联合国宪章》宗旨及国际关系基本准则，避免使叙利亚问题更加复杂化，避免给中东地区带来更多灾难。

他同时表示，“我们多次强调，中方反对任何人使用化学武器，支持联合国进行独立、公正、客观、专业的调查。国际社会采取任何行动的依据应当是有关调查结果，包括是否使

用了化学武器，包括谁使用了化学武器，这是未来国际社会采取行动的前提和条件。”

### 【路透调查显示投资者普遍削减新兴市场资产】

路透9月2日发布月度资产配置调查报告表示，由于对美联储何时开始削减购债计划不确定性的担忧，投资者纷纷削减新兴市场资产并增加欧元区资产，对全球经济前景持谨慎心态，具体表现为投资者的现金持仓量增加至近1年新高。

路透8月14日至29日调查了美国、欧洲及日本54家大型基金经理。调查数据显示，8月份投资者将亚洲股票配置比例由7月份的7.3%削减至6.9%，为2010年1月以来最低水平；并将同期欧元区股票配置比例由7月份的16.2%提高至16.7%，为2012年3月以来最高水平；欧元区债券配置比例由27.3%提高至27.5%，为2011年12月以来最高水平。

调查还显示，投资者现金持有比例从7月份的6.1%提高至6.2%，为2012年8月以来最高水平；股票配置比例由50.2%提升至50.7%，创近3个月高点；债券配置比例由37.0%下滑至36.5%。

### 【股票市场评论】

受周末利好消息提振，昨日大盘小幅高开，早盘受上海自贸区等区域性概念股杀跌拖累出现快速跳水，盘中一度失守10日线支撑，酿酒、地产板块也出现大幅下挫，盘中最低下探至2078点，之后在20日线支撑作用下出现快速回升；午后机械、煤炭、有色等周期板块集体上扬推动大盘翻红，最终收出十字假阴线，成交量较前日明显萎缩。

盘面上看，两市板块个股涨多跌少，共38只个股涨停，15只个股跌停，市场整体呈震荡整理走势，个股分化异常明显，上海自贸区、天津滨海新区等区域板块普遍回调，尤其是港口题材股出现跌停潮，对市场造成不利影响；此外，酿酒板块也因业绩下滑出现普遍大跌；农林牧渔板块则受土地流转消息提振领涨两市。技术上看，大盘已连续5个交易日在2100点上下反复震荡，MACD指标红柱缩短，近期如不能放量突破2120点阻力则有回调风险。总体看，近期PMI数据已表明宏观经济正处于复苏阶段，这为市场热点的持续活跃创造了良好条件，而上海自贸区、土地流转等概念板块的反复活跃也再次表明机会仍然存在于和改革方向相一致的板块中。

本资讯产品所有数据均来自wind资讯

## 东方基金声明

本资料所有内容均来自公开信息，不构成任何投资建议或承诺。本材料并非基金宣传推介资料，亦不构成任何法律文件。有关数据仅供参考，本公司不对其中的任何错漏和疏忽承担法律责任。本公司承诺以诚实信用，勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，基金过往业绩不代表其未来表现，基金管理人管理的其他基金业绩不构成新基金业绩表现的保证。投资人购买东方基金管理有限责任公司旗下的产品时，应认真阅读相关法律文件。本材料的版权归东方基金管理有限责任公司所有，未经我公司书面许可，任何机构和个人不得以任何形式转发、复制或修改。