

周资讯

第一百二十期

国内市场

指数名称	收盘	周涨跌	交易量
沪深 300	3382.55	-1.66%	4239 亿
上证指数	3103.04	-1.64%	7670 亿
深证成指	10024.44	-2.05%	9556 亿
中小板指	6493.18	-2.21%	3841 亿
创业板指	1818.19	-1.76%	2547 亿

外围市场

指数名称	收盘	周涨跌
标准普尔 500 指数	2399.29	0.63%
纳斯达克指数	6100.75	0.88%
恒生指数	24476.35	-0.56%
德国 DAX 指数	12718.66	2.24%
英国金融时报指数	7293.25	1.26%

商品期货市场

品种名称	收盘	周涨跌
纽约金	1228.4	-3.24%
原油	46.47	-5.53%
日元	112.70	1.05%
螺纹钢	3020	-3.04%
动力煤	516	-2.12%
股指期货	3360.4	-1.75%

【政策聚焦】

● 证券法修订草案二审 聚焦七大市场焦点

据新华社电 证券法修订草案 24 日提请全国人大常委会二审。在充分考虑我国证券市场实际情况、认真总结 2015 年股市异常波动经验教训的基础上，证券法修订草案二次审议稿聚焦七大市场焦点。

- 1: 关于注册制：具体内容暂不规定
- 2: 监管：执法权限，处罚力度双升级
- 3: 收购：增持资金应说明来路
- 4: 信息披露：全面升级为专章规定
- 5: 证券交易：增加操纵市场等情形
- 6: 投资者保护：按专章做规定
- 7: 多层次资本市场：确定新三板为全国性证券交易场所

● 又一大监管地雷引爆，券商资管全面叫停，规模达 17 万亿

新融街财经讯，昨日政治局再次召开会议，专门落实国家金融安全工作，保监会，银监会，证监会，各大交易所多做出明确部署，全国范围的金融整顿风暴第二波来临。4 月份对于银行间委外的赎回风波已经让市场风声鹤唳，草木皆兵，而昨天晚上出来开始全面检查券商资管资金池业务，再次把二级市场推上了风口浪尖！从政治局密集召开国家金融安全会议透露出的信号看出，本轮金融风暴才刚开始！对于，证券二级市场的监管风暴也才刚启幕！从去年年底的数据来看，券商资管业务整体规模达到 17 万亿元！

【行业直击】

● 2017年4月私募基金行业发展情况

截止2017年4月30日，基金业协会登记私募基金管理人18910家，备案私募基金62201只，私募基金从业人员301978人，外包服务机构中份额登记37家、估值核算40家、信息技术5家。

私募基金管理人类别：

管理基金主要类别	数量（家）	占比
证券投资基金	6273	33.17%
股权投资基金	3268	17.28%
股权、创业投资基金	8865	46.88%
其他投资基金	504	2.67%
合计	18910	100%

私募基金类型：

基金类型	数量（只）	占比
证券投资基金	28887	46.44%
股权投资基金	17376	27.94%
创业投资基金	2561	4.12%
其他投资基金	6385	10.27%
基金专户	2039	3.28%
基金子公司	846	1.36%

证券公司及其子公司的资	283	0.45%
期货公司及其子公司的资	773	1.24%
保险公司及其子公司的资	24	0.04%
信托计划	2920	4.69%
银行理财产品	8	0.01%
QFII	1	0.00%
其他	98	0.16%
合计	62201	100%

● 一季度私募基金规模猛增 1.66 万亿！但百亿级证券私募缩至 26 家

2017 年，在宏观经济缓慢复苏的背景下，私募行业规模稳中求进。基金业协会备案数据显示，继 2016 年底突破十万亿大关后，截至 2017 年 2 月底，私募基金行业认缴规模又增长 1.11 万亿，总规模已达 11.35 万亿，超公募基金资产规模（8.82 万亿）近 30%。

2017 一季度百亿级私募管理人名录：

私募机构	核心人物	成立时间	投资策略
北京地区			
淡水泉投资	赵军	2007	股票
星石投资	江晖	2007	股票
和聚投资	于军，李泽刚	2009	股票、定增
远策投资	张益驰	2009	股票、定增
佑瑞持投资	高蕾	2010	债券
乐瑞资产	唐毅亭	2011	债券、宏观对冲

暖流资产	程鹏	2011	债券
千合资本	王亚伟	2012	股票
千为投资	王林	2012	债券
蓝石资管	朵元	2015	债券
上海地区			
景林资产	蒋锦志	2004	股票、定增
六禾投资	夏晓辉	2004	股票、定增
朱雀投资	李华轮	2007	股票、量化对冲
重阳投资	裘国根	2009	股票
银叶投资	许己阳	2009	股票、债券、宏观对冲
青雅投资	郭强	2009	债券
耀之资产	王小坚	2011	债券
合晟资产	胡远川	2011	债券
映雪投资	郑宇	2012	股票、债券、复合策略
富善投资	林成栋	2013	股票、定增、量化对冲
博道投资	莫泰山	2013	股票、债券、量化对冲
茂典资产	梅东亚	2013	股票、债券、定增
深广及其他地区			
瀚信资产	蒋国云	2010	股票
盈峰资本	张冰	2013	股票、量化对冲
大岩资本	汪义平	2013	股票、定增、量化对冲
友山基金	何炫	2013	股票、定增、相对价值

● 券商经纪业务排行榜和佣金率

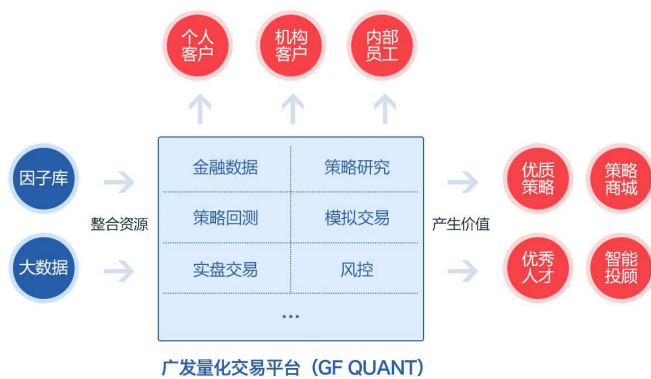
排名	证券公司	2016 年	2015 年	同比	平均佣金率
1	中信证券	121.12	217.12	-44.22	0.066%
2	华泰证券	101.98	179.85	-43.3	0.034%
3	中国银河	99.51	208.34	-52.23	0.043%
4	广发证券	89.39	175.98	-49.2	0.041%
5	海通证券	85.14	162.49	-47.6	0.049%
6	国泰君安	80.13	184.68	-56.61	0.066%
7	申万宏源	75.83	173.76	-56.36	0.054%
8	招商证券	71.04	160.34	-55.7	0.052%
9	方正证券	62.79	93.75	-33.02	0.053%
10	东方证券	41.54	52.71	-21.19	0.040%
11	光大证券	30.94	76.37	-59.49	0.054%
12	兴业证券	26.67	54.33	-50.91	0.035%
13	长江证券	21.08	59.22	-64.4	0.041%
14	国金证券	17.43	34.04	-48.8	0.041%
15	东吴证券	16.45	30.26	-45.63	0.043%
16	华安证券	11.57	27.34	-57.69	0.060%
17	中原证券	11.21	17.71	-58.00	0.057%
18	西南证券	10.03	26.83	-62.62	0.046%
19	国海证券	8.9	24.79	-26.79	0.054%
20	太平洋	7.96	14.87	-46.5	0.069%
21	第一创业	5.43	10.51	-48.31	0.044%
按 70%估算所有券商总营		1422	2835	-50	0.055%

【软件动态】

● 聚宽助力广发证券打造国内首个券商版量化交易平台

以美国为主的成熟资本市场，量化交易占比超过 50%，量化对冲基金已经成为资管市场的翘楚。中国的量化交易起步较晚，量化交易在证券市场占比还不足 5%。随着科技的进步，中国的量化交易市场正在快速发展。目前，量化交易已逐渐成为资管行业的热点。正是基于这一趋势，广发证券率先发力，联合聚宽，双方历时三个月精心打造，于 2017 年 4 月中旬上线了国内首家券商版量化交易平台。

广发量化交易平台（GF QUANT）借助聚宽在量化交易平台业务上的积累，结合广发证券的资讯云、大数据等特色业务，为客户提供了从策略研究、策略回测、模拟交易到实盘交易的一站式服务。平台不仅支持股票、股指期货、场内 ETF/LOF 基金等交易品种，还支持期权和融资融券等交易。



在金融数据方面，广发量化交易平台不仅提供股票行情数据、财务数据、场内 ETF/LOF 基金数据、指数数据，还提供了广发资讯云、广发大数据等特色数据。所有数据均经过了聚宽数据团队的专业清洗。

在策略研究方面，广发量化交易平台支持股票、基金、金融期货等品种的日级、分钟级回测和日级、分钟级、Tick 级模拟交易；后续平台还会继续增加商品期货、期权等多个类别。平台不仅支持编写多因子策略、事件驱动策略、统计套利策略、CTA 策略等各类策略，还提供了全量股票回测、参数调优、动态前复权回测等特色功能。

在实盘交易方面，广发量化交易平台即将上线实盘交易功能，依托 GF QUANT 的实盘交易、风控功能，用户可以方便、放心的使用策略进行实盘交易。