

金融期货晨报

日期：2014年6月24日

期谚日日谈

如果发现自己的洞中，最重要的事就是不要再挖下去。

——沃伦·巴菲特

观点与策略

股指期货：沪指昨日小幅震荡，期指高开低走均线系统粘合。

从整体上看，期指反弹乏力。IPO对资金分流的利空影响抵消了昨日PMI的利好效应。预计股指期货将继续弱势震荡。

作者姓名 黄婷

作者职称 分析师

作者联系方式 0571-86774356

国债期货：国债期货弱势震荡，成交量极度萎缩，市场观望

浓厚。IRR缩小至3.7%，银行间国债走势仍继续横盘震荡。

目前市场处于真空期，各方关注央行下一步政策走向。建议投资者观望为主。

作者姓名 黄浩

作者职称 分析师

作者联系方式 0571-86774356

金融期货主要数据一览

全球利率

	0/N	1W	1M	3M	6M	12M
Shibor	2.7550	3.4480	5.5260	4.7761	4.9136	5.0000
Tibor	-	0.1109	0.2400	0.2100	0.3046	0.3200
Libor 美元	0.0953	0.1230	0.1520	0.2326	0.3253	0.5471
Libor 英镑	0.4719	0.4769	0.4938	0.5525	0.6993	1.0431
Libor 欧元	0.0000	0.0429	0.0829	0.1786	0.2721	0.4417

全球汇率

	2014-6-23	2014-6-20	2014-6-19	2014-6-18	2014-6-17	2014-6-16
欧元中间价	8.3665	8.3743	8.3618	8.3403	8.3553	8.334
日元中间价	6.043	6.0528	6.0511	6.0421	6.0506	6.0469
美元中间价	6.1557	6.1524	6.1531	6.1559	6.1529	6.1537
美元指数	80.27	80.34	80.33	80.4	80.61	80.44
欧元兑美元	1.3604	1.36	1.3605	1.3587	1.3546	1.3571

各国股市概览

	收盘价	涨跌幅%		收盘价	涨跌幅%
道指	16937.26	-0.058	FTSE100	6800.56	-0.361
标普 500	1962.61	-0.013	日经 225	15369.28	0.129
德国 DAX	9920.92	-0.664	上证综指	2024.365	-0.114
法国 CAC	4515.57	-0.567	深证成指	7192.873	-0.039

国内金融期货前日涨跌

	收盘价	涨跌幅%	持仓量	成交量
IF1407	2123.2	-0.48	122399	585486
IF1409	2130	-0.44	49918	24386
TF1409	94.524	-0.035957	7231	947
TF1412	94.96	-0.021057	262	30

中债国债到期收益率

	1Y	3Y	5Y	7Y	10Y	15Y
2014-6-23	3.3788	3.7376	3.8518	3.9586	4.0515	4.2284
2014-6-20	3.4039	3.7264	3.8365	3.9599	4.0515	4.2284
2014-6-19	3.4123	3.7310	3.8492	3.9819	4.0408	4.2234
2014-6-18	3.3898	3.7522	3.8460	3.9697	4.0540	4.2366

市场资金加权平均利率

	R001. IB	R007. IB	GC001	GC007	IB0001	IB0007
2014-6-23	2.7733	3.4695	4.8958	5.5301	2.793	3.6195
2014-6-20	2.7824	3.4916	5.6613	5.1757	2.8071	3.6115
2014-6-19	2.7366	3.1760	14.3728	5.9979	2.7613	3.5033
2014-6-18	2.6711	3.0943	7.0336	6.0112	2.6937	3.3237

活跃 CTD 券情况

		收盘价	加权平均价	涨跌幅
2014-6-23	130015.IB	96.7846	96.8346	-0.0474
	130020.IB	100.1606	100.2725	0.0137
2014-6-20	130015.IB	96.8305	96.747	0.018696
	130020.IB	100.1469	100.0242	0.21986

金融市场隔夜要闻一览

- 1, 广东地方债招标利率公布 稍低于预期。**6月23日消息称,作为自发自还地方债的首个尝鲜者,广东省周一上午招标的三期地方债,利率稍低于预期,基本持平于同期限的国债。中债发行快报显示,广东省上午招标的五、七和10年固息地方债,中标利率分别为3.84%、3.97%和4.05%;此前市场预测均值为3.87%、3.99%和4.07%。
- 2, 海外人民币清算行再添两家 以助人民币国际化。**中国人民银行授权中国银行法兰克福分行担任法兰克福人民币业务清算行。就在前一天,中国建设银行(伦敦)有限公司被授权担任伦敦人民币业务清算行。而早在2013年2月8日,央行就指定中国工商银行新加坡分行为当地人民币业务清算银行。
- 3, 银行理财累计募资 68 万亿 超七成投入实体经济。**“截至2013年底,银行理财产品累计募集金额68万亿元,较上年大幅增长37.9%;年末余额达10.21万亿元,较年初增加了3.1万亿元,增长43.6%。”近日,中国银行业协会发布的《2013年中国银行业理财业务发展报告》披露了上述数据。从银行理财资金投向上看,70%以上理财资金投入了实体经济,已然成为实体经济的重要融资渠道,且产品与项目实现了逐一对应。
- 4, 首单交易所 ABS 终落地 未来消费类资产或成主攻方向。**6月23日,中国债券信息网和上海证券交易所公布平安银行1号小额消费贷款证券化信托资产支持证券(以下简称“平安1号”)发行文件,根据发行文件,当天下午13:00~15:00时开始申购。发行完成后,发行人将申请资产支持证券在上海证券交易所交易。这也是首只登陆交易所的银行信贷资产证券化产品(ABS)。
- 5, 转融券大扩容至 628 股 制度瓶颈多 “做空” 不给力。**6月23日,转融券试点范围全面扩大,试点券商、标的证券分别增至73家、628只。转融券标的扩大后,标的股票覆盖沪深市场绝大部分融资融券标的的股票,其流通市值达到A股流通市值的七成。然而,业内人士表示,转融券规模远远小于转融资的局面短期难以打破,而作为系统性问题,多个环节仍待打通。

