

# 金融期货晨报

日期：2014年7月29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：28日期指继续走强，主力合约IF1408上涨72.2点，近期公布的经济数据较好，投资者认为货币市场也将较为宽松，加上取消房产限购等现象引发投资者情绪高涨，多单可继续持有，但随着连续拉升，反弹幅度较大，时刻关注止盈。**

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：国债期货反弹受阻回落，成交量小幅萎缩。市场资金利率继续回落，二级市场国债到期收益率保持平稳，银行间市场活跃CTD券IRR仍处于低水平。国债期货仍具有反弹空间，建议多单持有。**

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	3.3040	4.0130	4.3980	4.7465	4.9000	5.0000
Tibor	-	0.1109	0.2400	0.2100	0.3000	0.3200
Libor 美元	0.0907	0.1218	0.1550	0.2361	0.3288	0.5636
Libor 英镑	0.4688	0.4769	0.4956	0.5583	0.7169	1.0650
Libor 欧元	0.0029	0.0421	0.0900	0.1764	0.2629	0.4436

## 全球汇率

	2014-7-28	2014-7-25	2014-7-24	2014-7-23	2014-7-22	2014-7-21
欧元中间价	8.2758	8.295	8.2876	8.2934	8.3241	8.327
日元中间价	6.0647	6.061	6.0726	6.0759	6.077	6.0872
美元中间价	6.1622	6.1597	6.1579	6.1572	6.1544	6.1547
美元指数	81	81.05	80.87	80.8	80.78	80.56
欧元兑美元	1.344	1.3434	1.3462	1.3463	1.3466	1.3522

## 各国股市概览

	收盘价	涨跌幅%		收盘价	涨跌幅%
道指	16982.59	0.130	FTSE100	6788.07	-0.051
标普 500	1978.91	0.029	日经 225	15529.4	0.463
德国 DAX	9598.17	-0.475	上证综指	2177.948	2.414
法国 CAC	4344.77	0.328	深证成指	7808.66	3.042

## 国内金融期货前日涨跌

	收盘价	涨跌幅%	持仓量	成交量
IF1408	2336.4	3.19	109968	891896
IF1409	2341.2	3.17	52303	80357
TF1409	93.072	-0.113761	6863	1582
TF1412	93.516	-0.076933	1058	89

## 中债国债到期收益率

	1Y	3Y	5Y	7Y	10Y	15Y
2014-7-28	3.7274	3.8954	4.0157	4.1920	4.2713	4.4545
2014-7-25	3.7238	3.8954	4.0202	4.1926	4.2711	4.4543
2014-7-24	3.7369	3.9112	4.0347	4.2055	4.2967	4.4788
2014-7-23	3.7794	3.9190	4.0292	4.2053	4.2967	4.4788

## 市场资金加权平均利率

	R001. IB	R007. IB	GC001	GC007	IB0001	IB0007
2014-7-28	3.3341	4.0330	3.6602	4.5589	3.3416	4.1967
2014-7-25	3.3698	4.1183	6.2445	5.0040	3.3798	4.2651
2014-7-24	3.3568	4.1588	17.2850	5.6209	3.3675	4.3794
2014-7-23	3.3452	4.3024	7.7519	5.6178	3.3552	4.5385

## 活跃 CTD 券情况

		收盘价	加权平均价	涨跌幅
2014-7-28	130015.IB	95.5467	95.3956	0.0672
	130020.IB	99.0349	98.9298	0.0571
2014-7-25	130015.IB	95.4825	95.3708	0.024827
	130020.IB	98.9784	98.9813	-0.012728

## 金融市场隔夜要闻一览

- 1, 权益市场风格转向大成景益平稳前瞻布局大盘转债。**7月市场风格出现转换,一波三连阳行情后,大盘成功收复“失地”,沪指创三个月新高。权益市场风格转向,使部分前瞻性布局大盘转债的偏债型基金获得良好收益。
- 2, 债基回暖货基稳健震荡 市配置防御性资产。**上海证券报金奖理财专区的金奖基金平台为投资者筛选出业绩稳健、风险控制良好的优秀基金组合,其中,进取型组合近一年收益 15.98%,均衡型组合近一年收益 2.54%,保守型组合近一年收益 3.02%,均大幅跑赢同期沪深 300 指数。
- 3, 铺路资产证券化 金融租赁专业子公司办法落地。**银监会发布《金融租赁公司专业子公司管理暂行规定》(以下简称《规定》),将此前发布的《金融租赁公司管理办法》中允许设立专业子公司的政策导向加以细化落地,给有志于设立专业子公司的金融租赁公司指出了明确的申请条件。
- 4, 海沧资本引爆资金池乱象 地产私募基金监管缺失。**业内人士透露,大量私募基金均存在类资金池,通过超募或假项目,借新还旧,一旦房地产市场变差,投资者观望,没有新的钱进来,就只好亏钱,或跑路。爆发于7月初的河北海沧延期兑付事件持续发酵。据知情人士7月下旬对21世纪经济报道记者称,目前已知的受损投资者达300多名,包括个人和机构投资者,分布于北京、上海、天津、广东、石家庄和福建等多地,被卷走金额至少5亿元人民币。
- 5, 中报整体净利预增 12% 产业资本、外资潜伏银行股。**交通银行(601328.SH)当天上午10点就被封在涨停板上,紧随其后的华夏银行(600015.SH)、宁波银行(002142.SZ)涨幅也分别达到7.36%和6.86%。民生、兴业和平安等银行股的涨幅都达到5%以上。近日有消息称,交通银行已经上报实施混合所有制的方案申请,正在等待相关部门批准。另外,沪港通预期带来的估值修复、基金补仓以及银行中报业绩较市场此前预料的要好,也是推动最近5个交易日银行股价上涨的重要因素。中金公司预测,上市银行中报业绩将整体保持12%的同比增长。
- 6, 中银协:到2013年末我国资产托管规模接近35万亿元。**中国银行业协会28日发布《2013年中国资产托管行业发展报告》。截至2013年末,国内托管资产规模突破达34.98万亿元,全年新增资产托管12.59万亿元,较上年增长56.23%。

## 免 责 条 款

本报告中的信息均来源于已公开的资料，我公司对这些信息的准确性及完整性不作任何保证，也不保证本公司作出的任何建议不会发生任何变更。在任何情况下，报告中的信息或所表达的意见并不构成所述期货买卖的出价或询价。在任何情况下，我公司不就本报告中的任何内容对任何投资作出任何形式的担保。本报告版权归大地期货有限公司所有。未获得大地期货有限公司事先书面授权，任何人不得对本报告进行任何形式的发布、复制。如引用、刊发，需注明出处为“大地期货有限公司”，且不得对本报告进行有悖原意的删节和修改。

**公司总部地址：浙江省杭州市延安路 511 号(浙江元通大厦十二楼)**

**联系电话：4008840077**

**邮政编码：310006**

杭州业务部地址	杭州市延安路511号元通大厦1508室	电话 :0571-85105765	邮编 :310006
衢州营业部地址	衢州市下街165号	电话 :0570-8505858	邮编 :324000
宁波营业部地址	宁波市海曙区冷静街8号银亿时代广场9-6	电话 :0574-87193738	邮编 :315000
台州营业部地址	台州市路桥区腾达路台州塑料化工市场1501-1504号	电话 :0576-82567007	邮编 :318050
温州营业部地址	温州市黎明中路143号海关大楼四楼东首	电话 :0577-88102788	邮编 :325000
诸暨营业部地址	浙江省诸暨市暨阳街道浣东北路108号时代广场东701室	电话 :0575-81785991	邮编 :311800
厦门营业部地址	厦门市思明区鹭江道96号之一钻石海岸A幢2705	电话 :0592-2058665	邮编 :361001
济南营业部地址	济南市历下区文化西路13号海辰办公写字楼1-302室	电话 :0531-55638700	邮编 :250063
上海营业部地址	上海市浦东新区松林路357号20层C、D座	电话 :021-60756218	邮编 :200122
北京营业部地址	北京市海淀区西三环北路89号中国外文大厦B座1102室	电话 :010-68731988	邮编 :100089
金华营业部地址	金华市婺江西路28号时代商务中心1幢1502-1503室	电话 :0579-82983181	邮编 :321001