

金融期货晨报

日期：2015年4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：A股上冲4400点回落，证监会多次提示风险，政府慢牛意图明显，昨日再度核发25家IPO批文，短期高位震荡加剧，短多离场。

作者姓名 黄婷

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 | 1.9490 | 2.5670 | 3.9080 | 4.4161 | 4.5960 | 4.6935 |
| Tibor | - | 0.1082 | 0.0000 | 0.1718 | 0.2573 | 0.2836 |
| Libor 美元 | 0.1220 | 0.1465 | 0.1818 | 0.2775 | 0.4049 | 0.6992 |
| Libor 英镑 | 0.4806 | 0.4853 | 0.5069 | 0.5659 | 0.6963 | 0.9799 |
| Libor 欧元 | -0.1707 | -0.1007 | -0.0457 | -0.0050 | 0.0607 | 0.1800 |

全球汇率

| | 2015-4-23 | 2015-4-22 | 2015-4-21 | 2015-4-20 | 2015-4-17 | 2015-4-16 |
|-------|-----------|-----------|-----------|-----------|-----------|-----------|
| 欧元中间价 | 6.5794 | 6.5861 | 6.5942 | 6.6325 | 6.6125 | 6.5814 |
| 日元中间价 | 5.1208 | 5.1345 | 5.151 | 5.1659 | 5.1678 | 5.1689 |
| 美元中间价 | 6.1281 | 6.129 | 6.128 | 6.1255 | 6.1267 | 6.1305 |
| 美元指数 | 97.3056 | 98.0628 | 97.9716 | 97.9102 | 97.4538 | 97.6466 |
| 欧元兑美元 | 1.0821 | 1.0721 | 1.0738 | 1.074 | 1.0805 | 1.0764 |

各国股市概览

| | 收盘价 | 涨跌幅% | | 收盘价 | 涨跌幅% |
|--------|----------|--------|---------|-----------|--------|
| 道指 | 18058.69 | 0.113 | FTSE100 | 7053.67 | 0.362 |
| 标普 500 | 2112.93 | 0.236 | 日经 225 | 20187.65 | 0.267 |
| 德国 DAX | 11723.58 | -1.212 | 上证综指 | 4414.508 | 0.364 |
| 法国 CAC | 5178.91 | -0.618 | 深证成指 | 14743.217 | -0.040 |

国内金融期货前日涨跌

| | 收盘价 | 涨跌幅% | 持仓量 | 成交量 |
|--------|--------|-----------|-------|--------|
| if | 4727.2 | -0.588829 | 64658 | 173350 |
| TF1503 | 98.15 | -0.056005 | 35830 | 9187 |
| TF1506 | 98.57 | -0.091222 | 8432 | 894 |

中债国债到期收益率

| | 1Y | 3Y | 5Y | 7Y | 10Y | 15Y |
|-----------|--------|--------|--------|--------|--------|--------|
| 2015-4-23 | 2.9713 | 3.2109 | 3.2936 | 3.4118 | 3.4151 | 3.6789 |
| 2015-4-22 | 3.0152 | 3.1450 | 3.2891 | 3.3776 | 3.4052 | 3.6690 |
| 2015-4-21 | 3.0092 | 3.1193 | 3.2857 | 3.3570 | 3.4055 | 3.6693 |
| 2015-4-20 | 3.0872 | 3.1526 | 3.3165 | 3.4094 | 3.4554 | 3.7192 |

市场资金加权平均利率

| | R001. IB | R007. IB | GC001 | GC007 | IB0001 | IB0007 |
|-----------|----------|----------|--------|--------|--------|--------|
| 2015-4-23 | 1.8899 | 2.5408 | 1.7404 | 2.1211 | 1.9525 | 2.7282 |
| 2015-4-22 | 1.9174 | 2.5626 | 1.4902 | 2.0291 | 1.9833 | 2.9169 |
| 2015-4-21 | 2.0010 | 2.6379 | 1.3811 | 2.0795 | 2.0367 | 2.8718 |
| 2015-4-20 | 2.0780 | 2.7851 | 1.5595 | 2.1821 | 2.1270 | 3.2287 |

活跃 CTD 券情况

| | | 收盘价 | 加权平均价 | 涨跌幅 |
|-----------|-----------|----------|----------|---------|
| 2015-4-23 | 140024.IB | 101.5916 | 101.4162 | -0.1719 |
| | 150002.IB | 99.7518 | 99.7692 | -0.1784 |
| 2015-4-22 | 140024.IB | 101.7665 | 101.7494 | 0.2276 |
| | 150002.IB | 99.9301 | 100.0026 | -0.0001 |



金融市场隔夜要闻一览

◆央行上海总部：正式启动自由贸易账户外币服务功能。上海自贸区管委会：上海资本项目可兑换方案正报批。

◆证监会副主席姜洋：待《海峡两岸服务贸易协议》实施后，将允许台资金融机构以人民币合格境外机构投资者(RQFII)方式投资大陆资本市场，进一步便利台资证券公司申请大陆 QFII 资格，允许符合条件的台资金融机构在大陆设立合资公司并提高持股比例等。

◆央行：3月末工农中建四大行合计人民币贷款余额为 33.8 万亿元；3月四大行新增人民币贷款 4673 亿元，较上月末增长 1.4%。

◆监管层将对银行卡清算机构实行牌照管理，外资将参与银行卡清算市场竞争，银联垄断地位不保。

◆中国人民大学校长陈雨露：从目前的高达 18.5%的存款准备金率来看，以及 CPI 和经济走势来看，还有进一步降准的空间和可能。

◆前海金控成功发行规模 10 亿元人民币的信用增强离岸人民币债券（点心债），并获得 130 亿元认购额，超额认购达 12 倍。这也成为海外市场第一单具有前海概念的人民币债券。

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 |