

金融期货晨报

日期：2015年5月13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

周三期指大幅震荡，三大期指分化严重，中证500指数依旧强势，上证50弱势回调，期指IF1505本周五交割，但贴水幅度较大，可参与反向套利（昨日300ETF出现天量融券卖出，有套利资金入场），短期仍可逢低买入期指。

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

全球汇率

	2015-5-13	2015-5-12	2015-5-11	2015-5-8	2015-5-7	2015-5-6
欧元中间价	6.8768	6.8309	6.8589	6.8936	6.9426	6.8539
日元中间价	5.1143	5.1087	5.1249	5.1219	5.1337	5.1171
美元中间价	6.1123	6.1155	6.1132	6.1147	6.1113	6.1156
美元指数	93.6716	94.5413	95.0363	94.8102	94.6012	94.147
欧元兑美元	1.135	1.1219	1.1151	1.12	1.1247	1.1342

市场资金加权平均利率

	R001.IB	R007.IB	GC001	GC007	IBO001	IBO007
2015-5-13	1.2283	2.0955	1.0969	2.0583	1.3029	2.2961
2015-5-12	1.2745	2.1844	1.1481	1.6259	1.3478	2.3725
2015-5-11	1.3216	2.2567	1.4966	1.7309	1.403	2.4641
2015-5-8	1.4199	2.3370	2.1052	1.9272	1.4883	2.5906

国债到期收益率

	1Y	3Y	5Y	7Y	10Y	15Y
2015-5-12	2.5691	2.9941	3.1677	3.4100	3.4002	3.6901
2015-5-11	2.6562	3.0523	3.2170	3.4100	3.3752	3.6650
2015-5-8	2.6821	3.0917	3.2484	3.4002	3.3703	3.6601
2015-5-7	2.6912	3.1273	3.2828	3.4400	3.4401	3.7299

活跃 CTD 券情况

		收盘价	加权平均价	涨跌幅
2015-5-13	140024.IB	101.5221	101.7067	-0.0573
	150002.IB	99.7255	99.6841	0.0324
2015-5-12	140024.IB	101.5803	101.6197	0.0561
	150002.IB	99.6932	99.7148	-0.0590

全球利率

	0/N	1W	1M	3M	6M	12M
Shibor	1.2470	2.1490	3.0420	3.6340	4.0460	4.3845
Tibor	-	0.1082	0.0000	0.1709	0.2573	0.2836
Libor 美元	0.1230	0.1485	0.1848	0.2799	0.4143	0.7326
Libor 英镑	0.4813	0.4893	0.5085	0.5675	0.7019	0.9971
Libor 欧元	-0.1729	-0.1300	-0.0600	-0.0164	0.0536	0.1729

各国股市概览

	收盘价	涨跌幅%		收盘价	涨跌幅%
道指	18060.49	-0.043	FTSE100	6949.63	0.228
标普 500	2098.48	-0.030	日经 225	19764.72	0.713
德国 DAX	11351.46	-1.054	上证综指	4375.76	-0.578
法国 CAC	4961.86	-0.257	深证综指	15173.092	0.709

国内金融期货前日涨跌

	收盘价	涨跌幅%
if	4653.2	-0.83962
TF1503	97.445	0.149024
TF1506	98.075	0.132728



金融市场隔夜要闻一览

- ◆ 央行和银监会口头干预“稳楼市”：要求银行及时发放个人房贷，优先满足首套房贷需求。
- ◆ 4月投资、工业、消费、发电量数据均较3月下滑，其中地产投资、地产相关消费均有不同程度下滑，在地产持续低迷以及4月财政支出放缓的情况下经济数据进一步下行并不奇怪。央行和银监会与商业银行座谈要求加快住房按揭贷款的发放，并对首套房贷款提供一定的政策倾斜，显示政府对地产的暧昧态度，政策不会容忍地产一路下滑，后期政策仍将相机而动。
- ◆ “沪苏浙皖超级经济区”浮出水面：长三角包括安徽，南通划入上海。
- ◆ 中国1~4月房地产投资同比名义增16.4%，住宅投资增速、商品房销售面积等关键指标几乎全线回落。
- ◆ 银监会出台监管细则，禁止非金融机构推介信托。
- ◆ 资源股的一日游行情再度向投资者确认，当前A股市场仅仅是存量资金的折腾而已，没有重量级实质性政策出台，股市很难发动起像样的行情。继4月社融和信贷数据不及预期后，发电量、投资等指标也步其后尘，经济基本面继续恶化的迹象越来越多，政策出手的声音再度随之升温，今年年中时点上调控政策重回稳增长的概率越来越高。传统的政策托底板块和混合所有制驱动的央企映射链条都具有较好的底仓价值。
- ◆ 美财长称中国汇改有所倒退；财政部副部长朱光耀称人民币汇率政策方向正确，汇率波动反映市场需求。。

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