



日期：2015年5月19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

金融期货主要数据一览

全球汇率

	2015-5-18	2015-5-15	2015-5-14	2015-5-13	2015-5-12	2015-5-11
欧元中间价	7.0022	6.979	6.9472	6.8768	6.8309	6.8589
日元中间价	5.1315	5.1376	5.1386	5.1143	5.1087	5.1249
美元中间价	6.1079	6.1085	6.1093	6.1123	6.1155	6.1132
美元指数	94.1663	93.2684	93.3873	93.6716	94.5413	95.0363
欧元兑美元	1.1314	1.1442	1.1408	1.135	1.1219	1.1151

市场资金加权平均利率

	R001.IB	R007.IB	GC001	GC007	IBO001	IBO007
2015-5-18	1.0363	1.9640	1.2925	2.6535	1.1111	2.1653
2015-5-15	1.0571	1.9393	1.1600	2.6852	1.1455	2.3630
2015-5-14	1.1519	2.0056	1.2985	2.5659	1.237	2.2943
2015-5-13	1.2283	2.0955	1.0969	2.0583	1.3029	2.2961

国债到期收益率

	1Y	3Y	5Y	7Y	10Y	15Y
2015-5-18	2.374	2.8204	3.0820	3.3586	3.4109	3.7005
2015-5-15	2.344	2.7681	3.0508	3.3559	3.3907	3.6803
2015-5-14	2.3557	2.8524	2.9869	3.3672	3.3803	3.6702
2015-5-13	2.4501	2.9361	3.0637	3.3914	3.4002	3.6901

活跃 CTD 券情况

		收盘价	加权平均价	涨跌幅
2015-5-18	140024.IB	101.9799	101.6618	-0.0573
	150002.IB	100.0469	99.9828	-0.0001
2015-5-15	140024.IB	102.0384	101.9319	0.2816
	150002.IB	100.047	99.9978	0.0588

全球利率

	0/N	1W	1M	3M	6M	12M
Shibor	1.0520	1.9200	2.6640	3.2000	3.7720	4.1710
Tibor	-	0.1082	0.0000	0.1709	0.2573	0.2836
Libor 美元	0.1240	0.1490	0.1862	0.2765	0.4128	0.7234
Libor 英镑	0.4813	0.4905	0.5066	0.5669	0.7068	0.9968
Libor 欧元	-0.1779	-0.1414	-0.0629	-0.0150	0.0536	0.1743

各国股市概览

	收盘价	涨跌幅%		收盘价	涨跌幅%
道指	18298.88	0.144	FTSE100	6968.87	0.120
标普 500	2129.2	0.305	日经 225	19890.27	0.797
德国 DAX	11594.28	1.286	上证综指	4283.491	-0.585
法国 CAC	5012.31	0.370	深证综指	14672.632	-0.152

国内金融期货前日涨跌

	收盘价	涨跌幅%
if	4536.8	-1.796615
TF1503	97.71	-0.056257
TF1506	98.24	-0.035614



金融市场隔夜要闻一览

- ◆ 同业新规姗姗来迟，五部委联合开启同业整顿风暴。

2013 年末银行业金融机构纳入存放同业、拆出资金和买入返售金融资产项下核算的同业资产达到 21.47 万亿元，新规将同业资产纳入总额度管理，但是没有直接要求将同业资产与一般贷款同等对待纳入计提资本和准备金统计。短期对同业和非标扩张有一定冲击，但又不算最严厉的冲击，还是意在控制同业业务总体的宏观风险。

- ◆ 中国证监会正式发布创业板 IPO 和再融资办法，首发取消持续增长要求。
- ◆ 今年经济改革完成九大任务加快铁路投融资改革。

上周尽管有“新国九条”的助推，A 股市场仍然先扬后抑，涨幅几乎被抹平，弱势特征尽显。而周五关于监管银行同业的九号文正式出台，再度亮出央行“控风险、去杠杆”的政策态度。《通知》的核心意图在于限制金融机构通过同业业务规避监管，引导影子银行资产业务回表，由于对存量业务未做强制性要求，谈不上引爆短期金融风险，但融资偏紧的行业将面临更大压力，对股市的基本面和资金面都不是什么正面信号，A 股重心下沉的趋势被进一步确认。

- ◆ 周小川考虑借鉴西方央行政策利率，通过向金融机构注资抽资使利率运行于设定的区间内。
- ◆ 国家发改委：今年经济改革九大任务，房地产税、盐业改革位列其中。
- ◆ 中国房地产市场降价潮蔓延，4 月房价环比下降城市增至 8 个。
- ◆ 外交部：暂停中越部分双边交往；公安部：越南暴力事件后果“非常严重”。

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