

 **金融期货晨报**

期 期：2015 年 8 月 18 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：**昨日大盘继续窄幅震荡，沪指下探至 3900 点后反弹逼近 4000 点，权重板块仍表现不佳。目前沪指持续于 4000 点下方徘徊，区间震荡中寻求突破，新的热点逐步形成。IF1508 围绕 4000 点争夺，IH 与 IC 出现明显分化，建议 IF1508 日内震荡操作。

**国债期货：**昨日期债低开震荡，成交量小幅上升，国债收益率保持平稳，市场资金利率继续回升。期债技术面偏弱，市场仍保持谨慎，关注央行动作，建议短线做多为主。

# 金融期货主要数据一览

## 全球利率

	0/N	1W	1M	3M	6M	12M
Shibor	1.7010	2.5170	2.6910	3.0910	3.2052	3.3925
Tibor	-	0.1082	0.0000	0.1709	0.2573	0.2836
Libor 美元	0.1305	0.1530	0.1996	0.3245	0.5249	0.8441
Libor 英镑	0.4813	0.4850	0.5091	0.5844	0.7500	1.0553
Libor 欧元	-0.1800	-0.1657	-0.1000	-0.0271	0.0527	0.1574

## 全球汇率

	2015-8-17	2015-8-14	2015-8-13	2015-8-12	2015-8-11	2015-8-10
欧元中间价	7.0943	7.1325	7.101	6.9481	6.7633	6.7226
日元中间价	5.1451	5.1441	5.126	5.0524	4.9319	4.9428
美元中间价	6.3969	6.3975	6.401	6.3306	6.2298	6.1162
美元指数	96.819	96.6024	96.3754	96.3251	97.198	97.1855
欧元兑美元	1.1078	1.1105	1.1152	1.1157	1.1041	1.1016

## 各国股市概览

	收盘价	涨跌幅%		收盘价	涨跌幅%
道指	17545.1	0.388	FTSE100	6550.3	-0.007
标普 500	2102.4	0.521	日经 225	20620.2	0.491
德国 DAX	10940.3	-0.408	上证综指	3993.6	0.715
法国 CAC	4984.8	0.572	深证成指	13573.9	0.952

## 国内金融期货前日涨跌

	收盘价	涨跌幅%	持仓量	成交量
IF1508	4003.8	-0.149633	53579	1661291
IF1509	3897	-0.698196	43600	153846
TF1509	96.39	-0.222556	8238	4231
TF1512	98.15	-0.259133	9725	2290

## 中债国债到期收益率

	1Y	3Y	5Y	7Y	10Y	15Y
2015-8-17	2.2466	2.9324	3.2521	3.5033	3.5176	3.6856
2015-8-14	2.3273	2.9117	3.2558	3.4883	3.5052	3.6731
2015-8-13	2.2883	2.9397	3.2649	3.4856	3.5153	3.6832
2015-8-12	2.3181	2.9635	3.2661	3.5191	3.5402	3.7081

## 市场资金加权平均利率

	R001. IB	R007. IB	GC001	GC007	IB0001	IB0007
2015-8-17	1.7214	2.5050	1.2223	1.5573	1.7092	2.538
2015-8-14	1.6855	2.4992	1.3659	1.5050	1.6847	2.5259
2015-8-13	1.6545	2.4815	1.5551	1.6018	1.6507	2.5787
2015-8-12	1.6255	2.4519	1.2361	1.7523	1.6376	2.5418

## 活跃 CTD 券情况

		收盘价	加权平均价	涨跌幅
2015-8-17	150007.IB	100.1911	100.1020	-0.0880
	150002.IB	98.2000	0.0000	0.0000
2015-8-14	150007.IB	100.2793	100.2737	-0.0004
	150002.IB	98.2	98.3846	-0.7725

## 金融市场隔夜要闻一览

- 1, 流动性边际趋紧 降准预期升温。**在央行宣布完善人民币对美元汇率中间价报价后,市场对流动性整体走向的关注升温。分析人士指出,综合人民币汇率阶段性走弱预期,参考银行间资金利率、商业银行体系超储率、外汇占款下降、央行公开市场操作等多方面因素,在当前流动性边际趋紧背景下,下调存款准备金率等宽松举措有望出台。
- 2, 彭博:中央汇金计划 9 月发债 300 亿元。**外媒援引知情人士称,中央汇金计划发行 300 亿元人民币债券;此次债券发行计划安排在 9 月初,发行期限尚未最后确定,从一年到十年期均在考虑。中央汇金最后一次公开发行债券为 2010 年。
- 3, 沪指涨 0.71% 逼近 4000 点。**两市双双低开,之后沪指震荡下挫跌逾 1%,深成指盘中一度翻红,但很快掉头向下。午后,两市震荡整理。13:54 过后,两市强势拉升,沪指逼近 4000 点。随后沪指再度回落。截至收盘,沪指涨 0.71%,报 3993.67 点,成交 6263 亿元;深成指涨 0.95%,报 13573.9 点,成交 5604 亿元。
- 4, 社保 7 月新开 46 户扫货凶猛 QFII 连续 43 个月新开户。**按兵不动一年的社保基金终于出手了。近日中登公司的最新数据显示,7 月份社保基金新开立了 46 个 A 股账户,沪深两市各为 23 个。这也创下了 2008 年 11 月有相关统计以来社保基金的单月开户最多纪录。由此,社保基金开立的 A 股账户总数达到了 310 个。
- 5, 今年已发地方债 1.68 万亿 约 12747 亿公开招标发行。**据 Wind 统计,自 5 月 18 日 2015 年地方债发行正式启动以来,截至 8 月 17 日,已发行的地方债总额约 16824 亿元,其中约 12747 亿元的地方债采用公开招标发行方式。

## 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