

 **金融期货晨报**

期 期 : 2015 年 9 月 9 日

期 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：**昨日午后大盘开始反弹，中小盘股表现强劲，两市超 2200 股上涨，逾 300 股涨停，但成交量仍继续下滑。期指成交保持低迷。

**国债期货：**期债主力合约放量回落，国债二级市场价格出现下跌，市场短期资金利率有所回升。昨日财政部发文“更有力度财政政策”再居首位，债券供给可能进一步加大。受 150011.IB 价格回落影响，TF1512 IRR 水平大幅上升，而 T1512IRR 保持低位。建议今日多单继续持有。



## 金融期货主要数据一览

### 全球利率

	0/N	1W	1M	3M	6M	12M
Shibor	1.8970	2.4020	3.0180	3.0950	3.2880	3.4090
Tibor	-	0.1082	0.0000	0.1709	0.2573	0.2836
Libor 美元	0.0000	0.1543	0.2027	0.3330	0.5418	0.8601
Libor 英镑	0.4813	0.4855	0.5068	0.5863	0.7406	1.0499
Libor 欧元	-0.1800	-0.1671	-0.1079	-0.0379	0.0377	0.1489

### 全球汇率

	2015-9-8	2015-9-7	2015-9-4	2015-9-3	2015-9-2	2015-9-1
欧元中间价	7.1061	7.1042	-	-	7.1831	7.1718
日元中间价	5.332	5.3466	-	-	5.3021	5.2667
美元中间价	6.3639	6.3584	-	-	6.3619	6.3752
美元指数	95.8817	96.1471	96.2546	96.4019	95.911	95.32
欧元兑美元	1.1202	1.1168	1.1149	1.1116	1.1223	1.131

### 各国股市概览

	收盘价	涨跌幅%		收盘价	涨跌幅%
道指	16492.68	2.424	FTSE100	6146.1	1.178
标普 500	1969.41	2.508	日经 225	17427.08	-2.427
德国 DAX	10271.36	1.610	上证综指	3170.4522	2.923
法国 CAC	4598.26	1.069	深证成指	10320.226	3.287

### 国内金融期货前日涨跌

	收盘价	涨跌幅%	持仓量	成交量
IF1509	3338	6.994038	35438	28957
IF1512	3098.2	9.593208	9910	2552
TF1509	97.85	-0.254842	1383	55
TF1512	98.66	-0.187162	12449	10343

## 中债国债到期收益率

	1Y	3Y	5Y	7Y	10Y	15Y
2015-9-8	2.2737	2.9774	3.1763	3.3564	3.3603	3.5283
2015-9-7	2.2643	2.9659	3.1924	3.3499	3.3353	3.5033
2015-9-6	2.254	2.9405	3.1459	3.3249	3.3203	3.4884
2015-9-2	2.2586	2.9493	3.1428	3.3149	3.3002	3.4684

## 市场资金加权平均利率

	R001. IB	R007. IB	GC001	GC007	IB0001	IB0007
2015-9-8	1.8929	2.4393	1.3435	1.6119	1.928	2.6035
2015-9-7	1.9049	2.4327	1.2727	1.8434	1.9286	2.4540
2015-9-6	1.8681	2.3771	0.0000	0.0000	1.91	2.54
2015-9-2	2.0297	2.4616	1.6648	0.9423	2.0544	2.4624

## 活跃 CTD 券情况

		收盘价	加权平均价	涨跌幅
2015-9-8	150007.IB	101.0714	101.0758	-0.0201
	150003.IB	100.4277	100.6090	-0.1675
2015-9-7	150007.IB	101.0917	101.0937	-0.2913
	150003.IB	100.5962	100.6298	-0.0380



## 金融市场隔夜要闻一览

- 1, **财政部发文“更有力度财政政策”再居首位。**在经济增长放缓，市场期待更加积极的财政政策之时，9月8日，财政部网站通过《财政支持稳增长的政策措施》（下称《财政稳增长》）一文，介绍财政支持稳增长的政策措施实施情况及成效和下一步财政政策措施建议，值得关注的是，实施更有力度的财政政策再次被放在首位。
- 2, **中国市场企稳全球市场欢腾 A50 股指期货大涨 5%。**在 A 股和港股双双大涨的推动下，欧洲股市周二集体走高。泛欧 Stoxx600 指数涨超 1.5%，DAX 指数在德国进出口数据公布后涨幅超过 1.8%。市场风险偏好改善下新加坡富时中国 A50 指数 9 月期货合约涨超 5%，SPX 期货亦大涨。
- 3, **保监会调研：为保险机构登陆资本市场提供支持。**9月8日从保监会网站获悉，为加强对保险机构上市工作的监管，中国保监会办公厅发布关于开展保险机构上市计划调研工作的通知。
- 4, **沪指 V 型反转涨 2.92%。**周二早盘两市低开低走，开盘后沪指跌逾 1%，金融股盘中走强，沪指一度反弹翻红，临近午盘，两市再次直线跳水。午后沪指震荡走低一度跌逾 2%，随即银行股、上海本地股拉升护盘，推动各板块集体大涨，截至收盘，沪指报 3170.45 点，涨幅 2.92%，两市超 2200 股上涨，逾 300 股涨停。
- 5, **央行要求远期售汇交准备金 否认资本管制。**央行称，外汇风险准备金由金融机构交存，不针对企业。对于有实际套保需求的企业而言，影响并不大。

## 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