

 **金融期货晨报**

期 期 : 2015 年 9 月 16 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：昨日大盘继续下跌，中小票保持较大跌幅，市场对经济增速回落的担忧增加，资金持续从权益类产品流出，前期炒作的各概念均在目前较为悲观的情绪中破灭，建议观望。

国债期货：昨日期债增量上涨，价格突破 10 日均线，KDJ 出现交叉。国债收益率曲线中长端继续下移，市场短期资金利率保持低位。建议多单继续持有。



金融期货主要数据一览

全球利率

	0/N	1W	1M	3M	6M	12M
Shibor	1.8990	2.3920	3.0050	3.1130	3.3190	3.4120
Tibor	-	0.1082	0.0000	0.1709	0.2573	0.2836
Libor 美元	0.1360	0.1610	0.2090	0.3355	0.5418	0.8546
Libor 英镑	0.4825	0.4855	0.5079	0.5888	0.7531	1.0544
Libor 欧元	-0.1800	-0.1686	-0.1136	-0.0379	0.0306	0.1439

全球汇率

	2015-9-15	2015-9-14	2015-9-11	2015-9-10	2015-9-9	2015-9-8
欧元中间价	7.2027	7.2278	7.1875	7.1552	7.1265	7.1061
日元中间价	5.2898	5.2803	5.2753	5.3001	5.2964	5.332
美元中间价	6.3665	6.3709	6.3719	6.3772	6.3632	6.3639
美元指数	95.6286	95.258	95.1718	95.547	95.8939	95.8817
欧元兑美元	1.1265	1.1315	1.1339	1.1275	1.1216	1.1202

各国股市概览

	收盘价	涨跌幅%		收盘价	涨跌幅%
道指	16599.85	1.398	FTSE100	6137.6	0.871
标普 500	1978.09	1.283	日经 225	18026.48	0.338
德国 DAX	10188.13	0.557	上证综指	3005.1722	-3.520
法国 CAC	4569.37	1.134	深证成指	9290.807	-4.985

国内金融期货前日涨跌

	收盘价	涨跌幅%	持仓量	成交量
IF1509	3142.2	0.159378	22126	17635
IF1512	2799.8	-1.02517	11993	1993
TF1512	98.945	0.187323	12869	7081
TF1603	98.93	0.187351	2464	438

中债国债到期收益率

	1Y	3Y	5Y	7Y	10Y	15Y
2015-9-15	2.3261	2.9683	3.1562	3.3149	3.3104	3.4793
2015-9-14	2.2862	2.9708	3.1718	3.3448	3.3303	3.4983
2015-9-11	2.2543	2.9765	3.1918	3.3400	3.3404	3.5084
2015-9-10	2.2546	2.9938	3.1901	3.3549	3.3453	3.5133

市场资金加权平均利率

	R001. IB	R007. IB	GC001	GC007	IB0001	IB0007
2015-9-15	1.9106	2.3860	1.4323	1.7088	1.9298	2.4783
2015-9-14	1.8992	2.3780	1.3260	1.6918	1.9250	2.4681
2015-9-11	1.8988	2.3758	1.4560	1.5643	1.9401	2.5928
2015-9-10	1.8991	2.4478	1.7588	1.6968	1.9411	2.5181

活跃 CTD 券情况

		收盘价	加权平均价	涨跌幅
2015-9-15	150007.IB	101.2090	101.1306	0.0516
	150003.IB	100.5530	100.6078	-0.0781
2015-9-14	150007.IB	101.1568	101.1249	0.0286
	150003.IB	100.6316	100.6257	0.0862

金融市场隔夜要闻一览

- 1, **配资清理升级 非实名账户面临一刀切。**配资清查行动, 正从清查互联网配资向清理伞形信托过渡。种种迹象显示, 这种清理整顿仍在进一步扩散升级, 作为严格清理配资行动的蔓延, 通过第三方接入券商的非实名账户将面临“一刀切”清理。
- 2, **监管层回应信托券商纠纷: 要求券商承担违约责任缺依据。**伞形信托的清理, 让曾为亲密合作伙伴的信托与券商间正面对尖锐矛盾。就此问题, 证监会证券基金机构监管部主办的机构监管动态特刊, 刊出了规范场外配资活动专刊, 回答了证券业关于违法证券业务活动清理整顿政策的 6 项疑问。就信托公司认为伞形信托是合法备案的, 不同意清理问题, 监管层明确表示, 多项法律均禁止投资顾问拥有下单权, 个别信托要求券商承担违约责任缺乏合法依据。
- 3, **国务院: 免去庄心一证监会副主席职务 李超接任。**任命刘建超为国家预防腐败局副局长(专职, 副部长级); 任命李超为中国证券监督管理委员会副主席; 任命张克俭为国家国防科技工业局副局长(副部长级); 任命刘仓理为中国工程物理研究院院长(副部长级)。
- 4, **8 月地区物价报告: 一线城市“涨价”压力大。**经济发达地区的恩格尔系数低, 与其他地区相比食品对物价形成的压力有限, 但由于房价上升导致房租上涨等居住因素, 对物价上涨形成了较为突出的压力。
- 5, **国企改革顶层设计出炉 资本市场期待四大看点。**《关于深化国有企业改革的指导意见》近日发布, 市场期盼已久的指导和推进国企改革的纲领性文件终于落地。

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