

 **金融期货晨报**

»»» 日期：2015年9月17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：**昨日股票市场出现大幅反弹，14 时开始全线开始拉升，中小票表现强劲。近期沪指持续区间震荡，成交量萎缩，呈现缓慢企稳态势，但受制于基本面及市场信心，上方压力仍然较大。建议观望

**国债期货：**昨日期债小幅回落，成交量保持较高水平，国债到期收益率保持平稳，短期资金利率略有上升。美联储决议出台在即，对全球债市将会造成影响，市场分歧巨大，国内保守情绪上升，但国内资金产品配置仍使得国债具有较好吸引力。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	1.9000	2.3910	3.0180	3.1160	3.3240	3.4130
Tibor	-	0.1082	0.0000	0.1709	0.2573	0.2836
Libor 美元	0.1365	0.1621	0.2073	0.3343	0.5400	0.8546
Libor 英镑	0.4806	0.4855	0.5091	0.5875	0.7519	1.0569
Libor 欧元	-0.1800	-0.1679	-0.1143	-0.0443	0.0299	0.1431

## 全球汇率

	2015-9-16	2015-9-15	2015-9-14	2015-9-11	2015-9-10	2015-9-9
欧元中间价	7.1822	7.2027	7.2278	7.1875	7.1552	7.1265
日元中间价	5.2947	5.2898	5.2803	5.2753	5.3001	5.2964
美元中间价	6.3712	6.3665	6.3709	6.3719	6.3772	6.3632
美元指数	95.3398	95.6286	95.258	95.1718	95.547	95.8939
欧元兑美元	1.1288	1.1265	1.1315	1.1339	1.1275	1.1216

## 各国股市概览

	收盘价	涨跌幅%		收盘价	涨跌幅%
道指	16739.95	0.844	FTSE100	6229.21	1.493
标普 500	1995.31	0.871	日经 225	18171.6	0.805
德国 DAX	10227.21	0.384	上证综指	3152.2632	4.895
法国 CAC	4645.84	1.674	深证成指	9890.429	6.454

## 国内金融期货前日涨跌

	收盘价	涨跌幅%	持仓量	成交量
IF1509	3304.8	5.604908	15837	17246
IF1512	3001.8	7.283774	12285	2892
TF1512	98.84	-0.085924	12585	8224
TF1603	98.83	-0.07583	2581	390

## 中债国债到期收益率

	1Y	3Y	5Y	7Y	10Y	15Y
2015-9-16	2.333	2.9681	3.1413	3.3248	3.3103	3.4792
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

## 市场资金加权平均利率

	R001. IB	R007. IB	GC001	GC007	IB0001	IB0007
2015-9-16	1.9041	2.4129	1.5611	1.6964	1.9358	2.4864
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	1.925	2.4681
2015-9-11	1.8988	2.3758	1.4560	1.5643	1.9401	2.5928

## 活跃 CTD 券情况

		收盘价	加权平均价	涨跌幅
2015-9-16	150007.IB	101.3811	101.3749	0.1700
	150003.IB	100.6339	100.6300	0.0805
2015-9-15	150007.IB	101.209	101.1306	0.0516
	150003.IB	100.553	100.6078	-0.0781

## **金融市场隔夜要闻一览**

- 1, 证监会主席助理张育军落马 曾主导救市行动。**9月16日下午,证监会主席助理张育军涉嫌严重违纪,被中纪委调查。在迭起的反腐风暴中,金融系统一直没有太大的“动静”,而金融腐败一向被视为“技术含量”比较高的“专业”领域。因此,在业内人士看来,金融领域也是官商勾结的多发领域,“水很深”。
- 2, 存量配资暂缓清理 券商或全盘接手。**券商对配资的清理,也引发了券商和信托公司之间的“掐架”,两个不同监管主体下行业之间,引发的问题到底如何处理,也引发了各方争议。有法律界人士认为,非实名制账户违反证券法,监管部门可以采取强制措施,至于伞形信托,如果操作上有操纵股价等违法行为,监管部门也可以采取强制措施。
- 3, 银监系统紧急召集多家信托公司 闭门商讨伞形信托。**据证券时报,今日下午银监系统相关人士召开闭门会议,商讨证券信托问题。9月15日银监会信托部向京沪等地的多家信托公司直接下达通知,紧急召集公司一把手明日下午开会。
- 4, 美联储决议将掀腥风血雨。**彭博援引高盛首席经济学家 Jan Hatzius 称,关于美联储下一步将采取何种行动市场分歧很大,金融市场将很容易遭受冲击。Hatzius 还表示,决策者关于是否加息也缺少共识,因而美联储很有可能要等到12月或者明年才加息。高盛 CEO Blankfein 也表示,美国的经济数据不支持美联储加息。美联储量化宽松的结束和税收的上调对经济构成了阻碍,也成为了某种形式的紧缩。
- 5, 中国7月份减持304亿美元美债 捍卫人民币汇率。**美国财政部当地时间9月16日发布的国际资本流动报告(TIC)显示,中国在7月份大举减持了304亿美元美国国债,这不仅是半年来首次减持,也创下了2013年12月份(当月降了478亿美元)以来最大的单月减持额。分析认为,在经济增长速度放缓的形势下,中国正寻求为人民币提供保护,提前减持用于捍卫人民币汇率。

## 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