

 **金融期货晨报**

期 期：2015年9月18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：昨日股票市场尾盘出现急速下跌，成交量继续回升。消息面及基本面未出现明显变化，“清伞”的行动也难以造成实质性影响，市场信心仍然脆弱，建议观望。

国债期货：昨日期债继续回落，成交量保持较高水平，国债到期收益率及短期资金利率保持平稳。美联储决定维持利率不变，对债市起到正面影响，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	1.8990	2.3910	3.0370	3.1268	3.3242	3.4130
Tibor	-	0.1082	0.0000	0.1709	0.2573	0.2836
Libor 美元	0.1365	0.1646	0.2128	0.3396	0.5495	0.8666
Libor 英镑	0.4806	0.4855	0.5098	0.5875	0.7600	1.0725
Libor 欧元	-0.1807	-0.1693	-0.1157	-0.0400	0.0293	0.1431

全球汇率

	2015-9-17	2015-9-16	2015-9-15	2015-9-14	2015-9-11	2015-9-10
欧元中间价	7.1928	7.1822	7.2027	7.2278	7.1875	7.1552
日元中间价	5.2803	5.2947	5.2898	5.2803	5.2753	5.3001
美元中间价	6.367	6.3712	6.3665	6.3709	6.3719	6.3772
美元指数	94.5509	95.3398	95.6286	95.258	95.1718	95.547
欧元兑美元	1.1415	1.1288	1.1265	1.1315	1.1339	1.1275

各国股市概览

	收盘价	涨跌幅%		收盘价	涨跌幅%
道指	16674.74	-0.390	FTSE100	6186.99	-0.678
标普 500	1990.2	-0.256	日经 225	18432.27	1.434
德国 DAX	10229.58	0.023	上证综指	3086.0611	-2.100
法国 CAC	4655.14	0.200	深证成指	9739.89	-1.522

国内金融期货前日涨跌

	收盘价	涨跌幅%	持仓量	成交量
IF1509	3240.6	-0.680397	9471	11370
IF1512	2936	-0.89786	12350	2393
TF1512	98.655	-0.141708	12394	8029
TF1603	98.62	-0.187237	2787	392

中债国债到期收益率

	1Y	3Y	5Y	7Y	10Y	15Y
2015-9-17	2.3062	2.9822	3.1666	3.3200	3.3204	3.4893
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

市场资金加权平均利率

	R001. IB	R007. IB	GC001	GC007	IB0001	IB0007
2015-9-17	1.9013	2.3911	2.0530	1.6896	1.9374	2.5059
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	1.9250	2.4681

活跃 CTD 券情况

		收盘价	加权平均价	涨跌幅
2015-9-17	150007.IB	101.3811	101.3828	0.0000
	150003.IB	100.7147	100.6415	0.0803
2015-9-16	150007.IB	101.3811	101.3749	0.1700
	150003.IB	100.6339	100.63	0.0805



金融市场隔夜要闻一览

- 1, **美联储决定维持利率不变。**北京时间 18 日凌晨, 美联储结束此轮议息(FOMC)会议后宣布维持基准利率不变。有市场分析人士称, 美联储延期加息的主因一方面是近期金融市场吃紧, 反映出海外市场疲软加剧; 另一方面通货膨胀率也没有达到美联储预期标准。
- 2, **“清伞”不用砸盘 证监会紧急明确信托清查边界。**昨日, 赶在美联储主席耶伦公布是否加息的决定之前, 证监会紧急向市场清晰发声——信托产品账户清理范围限于三类, 禁止券商对信托“一断了之”, 涉及的股票划转可以不通过二级市场完成。换言之, “清伞”不等于清盘卖出。银监会也在昨日与多位信托高管进行通气会, 要求信托公司进一步自查并主动清理配资。
- 3, **银监会召集多家信托通气: 配资清理放缓推进。**证券时报记者获悉, 在银监会信托部今日下午与多位信托高管进行的通气会上, 监管部门要求信托公司进一步自查并主动清理配资, 而在时间要求上并未强调 9 月 30 日大限。
- 4, **美短债收益率重挫 年内升息压力减轻。**美国国债收益率周四(9 月 17 日)重挫, 两年期国债收益率单日降幅为六年半最大, 此前美联储(FED)在两日货币政策会议后决定维持利率不变。
- 5, **外汇局: 没有出台任何限制购售汇新政策。**外管局综合司司长王允贵昨日在 2015 年三季度政策新闻发布会上表示, 人民币兑美元已明显贬值, 贬值压力已经释放完毕, 且不存在诱发资金大幅流出的基础。

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