

 **金融期货晨报**

期 期 : 2015 年 10 月 14 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：昨日股票市场震荡上行，成交量萎缩。近期国际市场商品及股票价格出现企稳，市场对货币政策给予期望，但国内基本面未有明显改善，建议观望。

国债期货：期债昨日继续放量上行，TF1512 站上 100 元位置，国债现券价格也持续上涨，市场资金利率保持低位。期债主力合约 IRR 水平回升至 2%以上，五债溢价高于十债。今日 CPI 数据将会公布，同时关注今日国债发行情况及近期社会融资数据。建议观望。

金融期货主要数据一览

全球利率

	0/N	1W	1M	3M	6M	12M
Shibor	1.9000	2.3970	3.0900	3.1825	3.3481	3.4130
Tibor	-	0.1082	0.0000	0.1709	0.2573	0.2836
Libor 美元	0.0000	0.1553	0.1933	0.3208	0.5263	0.8395
Libor 英镑	0.4825	0.4856	0.5098	0.5756	0.7481	1.0381
Libor 欧元	-0.1800	-0.1693	-0.1221	-0.0457	0.0206	0.1264

全球汇率

	2015-10-13	2015-10-12	2015-10-9	2015-10-8	2015-9-30	2015-9-29
欧元中间价	7.1834	7.2109	7.164	7.1444	7.1608	7.1596
日元中间价	5.2709	5.2766	5.2935	5.2945	5.3043	5.3181
美元中间价	6.3231	6.3406	6.3493	6.3505	6.3613	6.366
美元指数	94.7781	94.8782	94.9041	95.2894	96.2692	95.9103
欧元兑美元	1.1381	1.1357	1.1353	1.1278	1.1172	1.1251

各国股市概览

	收盘价	涨跌幅%		收盘价	涨跌幅%
道指	17081.89	-0.292	FTSE100	6342.28	-0.454
标普 500	2003.69	-0.683	日经 225	18234.74	-1.106
德国 DAX	10032.82	-0.860	上证综指	3293.2301	0.169
法国 CAC	4643.38	-0.967	深证成指	11042.13	0.737

国内金融期货前日涨跌

	收盘价	涨跌幅%	持仓量	成交量
IF1510	3414.8	-0.466364	19269	11664
IF1512	3283.8	-0.785546	16107	2674
TF1512	100.28	0.330165	17342	22399
TF1603	100.27	0.30009	3699	1004

中债国债到期收益率

	1Y	3Y	5Y	7Y	10Y	15Y
2015-10-13	2.4186	2.8297	2.9237	3.1246	3.1064	3.4278
2015-10-12	2.4269	2.8497	2.9641	3.1598	3.1488	3.4421
2015-10-10	2.4116	2.8389	2.9538	3.1539	3.1612	3.4221
2015-10-9	2.4091	2.8535	2.9739	3.1794	3.1486	3.4096

市场资金加权平均利率

	R001. IB	R007. IB	GC001	GC007	IB0001	IB0007
2015-10-13	1.9031	2.4562	2.2286	2.4461	1.9284	2.5073
2015-10-12	1.9077	2.4227	2.6266	2.7703	1.9293	2.4478
2015-10-10	1.8785	2.3645	0.0000	0.0000	1.9258	2.4897
2015-10-9	1.8799	2.4826	4.1862	2.9840	1.9205	2.4757

活跃 CTD 券情况

		收盘价	加权平均价	涨跌幅
2015-10-13	150011.IB	100.8857	100.3890	0.2552
	150003.IB	101.5083	101.4332	0.1585
2015-10-12	150011.IB	100.6289	100.4247	0.1061
	150003.IB	101.3477	101.2586	0.1238



金融市场隔夜要闻一览

- 1, **习近平：解决改革利益调整中的阻力问题。**中共中央总书记、国家主席、中央军委主席、中央全面深化改革领导小组组长习近平 10 月 13 日上午主持召开中央全面深化改革领导小组第十七次会议并发表重要讲话。他强调，中央通过的改革方案落地生根，必须鼓励和允许不同地方进行差异化探索。全面深化改革任务越重，越要重视基层探索实践。要把鼓励基层改革创新、大胆探索作为抓改革落地的重要方法，坚持问题导向，着力解决好改革方案同实际相结合的问题、利益调整中的阻力问题、推动改革落实的责任担当问题，把改革落准落细落实，使改革更加精准地对接发展所需、基层所盼、民心所向，更好造福群众。
- 2, **证监会主席助理张育军被免职 传家中搜出大量现金。**10 月 13 日消息，在宣布被调查不到一个月时间后，证监会主席助理张育军被正式免职。据媒体报道，从接近案情的人士处获悉，就在宣布免职不久前，专案组从张育军家中，搜出大量现金。
- 3, **9 月份 CPI 今日公布 同比涨幅或重返“1 时代”。**国家统计局今日将公布 9 月份居民消费价格指数(CPI)。多家机构预测，受猪肉和蔬菜价格回落影响，9 月份 CPI 同比涨幅可能重回“1 时代”。分析认为，未来物价难以大幅度回升，预计全年涨幅将低于 2%。
- 4, **海关总署：前三季度贸易顺差 2.61 万亿 扩大 82.1%。**据海关统计，2015 年前三季度我国进出口总值 17.87 万亿元人民币，比去年同期下降 7.9%。其中，出口 10.24 万亿元，下降 1.8%；进口 7.63 万亿元，下降 15.1%；贸易顺差 2.61 万亿元，扩大 82.1%。
- 5, **高盛：新兴市场动荡 金融危机第三波来袭。**高盛在上周一份报告中指出，“新兴市场经济体疲软所造成的后果的不确定性，大宗商品价格下跌，以及美国可能提高利率，都令市场对资产价格上涨的可持续性产生新的担忧，这标志着全球金融危机的新的浪潮。”

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