

 **金融期货晨报**

期 期 : 2015 年 10 月 19 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：股票市场小幅放量上涨，资金出现持续回流，但做多热点仍偏向于中小票，对基本面的担忧制约蓝筹的上涨，建议短线轻仓试多。

国债期货：国债期货冲高回落，成交量迅速放大，TF1512 未能站稳 100 元关口。消息面央行信贷资产质押再贷款的炒作有所降温，期债带动现券上升的势头减弱，十债收益率过快破三消耗了较大下行空间，加之短期存在较多获利盘和大量投机筹码的进入，期债本周继续调整的可能性较大。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	1.8990	2.3940	3.0660	3.1826	3.3460	3.4150
Tibor	-	0.1082	0.0000	0.1709	0.2573	0.2836
Libor 美元	0.1325	0.1545	0.1968	0.3152	0.5159	0.8164
Libor 英镑	0.4825	0.4866	0.5066	0.5794	0.7463	1.0240
Libor 欧元	-0.1807	-0.1693	-0.1279	-0.0493	0.0184	0.1224

全球汇率

	2015-10-16	2015-10-15	2015-10-14	2015-10-13	2015-10-12	2015-10-9
欧元中间价	7.217	7.2694	7.2158	7.1834	7.2109	7.164
日元中间价	5.3389	5.3316	5.2978	5.2709	5.2766	5.2935
美元中间价	6.3436	6.3402	6.3408	6.3231	6.3406	6.3493
美元指数	94.7346	94.448	93.9143	94.7781	94.8782	94.9041
欧元兑美元	1.1347	1.1378	1.1479	1.1381	1.1357	1.1353

各国股市概览

	收盘价	涨跌幅%		收盘价	涨跌幅%
道指	17215.97	0.433	FTSE100	6378.04	0.621
标普 500	2033.11	0.457	日经 225	18291.8	1.077
德国 DAX	10104.43	0.394	上证综指	3391.3516	1.596
法国 CAC	4702.79	0.588	深证成指	11374.834	1.295

国内金融期货前日涨跌

	收盘价	涨跌幅%	持仓量	成交量
IF1510	3516.2	1.19726	0	8909
IF1512	3348	0.413892	18058	4033
TF1512	99.625	-0.3999	15097	33464
TF1603	99.66	-0.364909	3909	1090

中债国债到期收益率

	1Y	3Y	5Y	7Y	10Y	15Y
2015-10-16	2.432	2.8315	2.9660	3.1446	3.1216	3.4292
2015-10-15	2.419	2.7751	2.9059	3.1143	3.0814	3.3890
2015-10-14	2.4084	2.8037	2.8729	3.0548	3.0414	3.3629
2015-10-13	2.4186	2.8297	2.9237	3.1246	3.1064	3.4278

市场资金加权平均利率

	R001. IB	R007. IB	GC001	GC007	IB0001	IB0007
2015-10-16	1.9043	2.4284	2.5609	2.4588	1.9377	2.6159
2015-10-15	1.9057	2.4594	3.3604	2.4145	1.9405	2.5742
2015-10-14	1.9072	2.4729	1.9374	2.3038	1.9308	2.5423
2015-10-13	1.9031	2.4562	2.2286	2.4461	1.9284	2.5073

活跃 CTD 券情况

		收盘价	加权平均价	涨跌幅
2015-10-16	150011.IB	100.5199	100.0721	-0.4464
	150003.IB	101.5041	101.6223	0.2361
2015-10-15	150011.IB	100.9706	100.079	-0.1707
	150003.IB	101.265	101.8051	-0.3556

金融市场隔夜要闻一览

- 1, 中国三季度 GDP 数据今日公布 “破 7” 几乎成定局。**今天，国家统计局将公布第三季度 GDP，这再次成为关注焦点。《第一财经日报》梳理十家主流券商报告和多方预测发现，认为三季度 GDP 增速低于 7% 的观点超过九成，大部分预测在 6.7%~6.9% 范围内。
- 2, 三季央行外占降幅创纪录 流动性收缩或引发降准字号。**央行日前公布的数据显示，9 月份央行口径外汇占款环比减少 2641.42 亿元，创三个月来最小降幅；随后公布的数据却显示，9 月末金融机构口径外汇占款较上月下降 7613 亿元，至 27.4 万亿元，再创历史最大单月跌幅纪录。《每日经济新闻》记者注意到，央行口径和金融机构口径外汇占款的差值已连续两个月达 4000 亿元。
- 3, 港交所新战略计划：扩大优化与内地互联互通。**据港媒 19 日报道，2015 年即将完结，据了解，港交所正筹备最新一份集团战略计划，规划 2016 至 2018 年的未来三年策略大计，预期最快明年 1 月向外公布。业界认为，内地香港两地互联互通是港交所新一份战略计划最大推动引擎，估计未来三年会积极争取扩大及优化两地互联互通，同时为满足内地投资者的多元化投资需要，会增加更多产品，吸引海外公司来港上市。
- 4, 泛亚铁路年内开工建设 泰国或成最大赢家。**近日，在泰国东北部重镇呵叻举行的“中泰铁路合作研讨会”上，中国驻泰大使宁赋魁披露，10 月 28 至 29 日，中泰双方将在中泰铁路合作联合委员会第八次会议上，签署两国政府间铁路合作框架协议，抓紧实现年内开工建设的目标。
- 5, 中英关系步入新高点：经贸合作多点开花。**应英国女王伊丽莎白二世邀请，习近平主席将于 10 月 19 日至 23 日对英国进行国事访问。这将是 10 年来中国国家主席首次对英国进行国事访问，备受外界关注。在习近平主席到访前，海外媒体就此展开的相关讨论热度飙升。舆论认为，双方在高铁、核电、石墨稀及体育等领域的产业合作有望多点开花。英国媒体则将中英两国之间的经贸关系形容为正处于“黄金时期”。

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