

 **金融期货晨报**

期日 期：2015 年 10 月 21 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：股票市场小幅上涨，成交量萎缩，上证指数持续沿 5 日均线运行，市场信心缓慢恢复，但对基本面的担忧制约蓝筹板块的上行，短期恐面临调整。建议内轻仓试多

国债期货：昨日期债放量上冲，两主力合约回升至前期高位。市场资金利率保持低位，国债收益率曲线继续“牛平”移动。根据中债登数据显示，10 年期国债到期收益率离 3% 关口仅 6BP。目前，市场做多情绪持续上升，但若货币政策未进一步宽松，利率下方空间有限，下行阻力较大。预计期债将出现宽幅震荡，建议 TF1512 可日内区间操作，区间 99.7-100.5；或继续多 T1512 空 TF1512 操作。



金融期货主要数据一览

全球利率

	0/N	1W	1M	3M	6M	12M
Shibor	1.9030	2.3940	3.0490	3.1750	3.3510	3.4180
Tibor	-	0.1082	0.0000	0.1709	0.2573	0.2836
Libor 美元	0.1315	0.1558	0.1960	0.3167	0.5179	0.8262
Libor 英镑	0.4825	0.4863	0.5076	0.5794	0.7463	1.0321
Libor 欧元	-0.1807	-0.1693	-0.1279	-0.0571	0.0177	0.1217

全球汇率

	2015-10-20	2015-10-19	2015-10-16	2015-10-15	2015-10-14	2015-10-13
欧元中间价	7.2061	7.2201	7.217	7.2694	7.2158	7.1834
日元中间价	5.3255	5.3203	5.3389	5.3316	5.2978	5.2709
美元中间价	6.3614	6.3527	6.3436	6.3402	6.3408	6.3231
美元指数	94.8602	94.9176	94.7346	94.448	93.9143	94.7781
欧元兑美元	1.1346	1.1328	1.1347	1.1378	1.1479	1.1381

各国股市概览

	收盘价	涨跌幅%		收盘价	涨跌幅%
道指	17217.11	-0.08	FTSE100	6345.13	-0.11
标普 500	2030.77	-0.14	日经 225	18207.15	0.419
德国 DAX	10147.68	-0.16	上证综指	3425.3303	1.141
法国 CAC	4673.81	-0.64	深证成指	11597.08	1.809

国内金融期货前日涨跌

	收盘价	涨跌幅%	持仓量	成交量
IF1511	3466.6	2.62893	18993	13128
IF1512	3358	2.234671	19223	3157
TF1512	100.3	0.616943	16810	34135
TF1603	100.28	0.58679	4238	863

中债国债到期收益率

	1Y	3Y	5Y	7Y	10Y	15Y
2015-10-20	2.4255	2.7920	2.9058	3.0796	3.0615	3.3553
2015-10-19	2.4286	2.8122	2.9676	3.1372	3.1214	3.4042
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

市场资金加权平均利率

	R001. IB	R007. IB	GC001	GC007	IB0001	IB0007
2015-10-20	1.9204	2.4324	2.1159	2.3621	1.9349	2.4925
2015-10-19	1.9049	2.4408	2.3918	2.5214	1.9419	2.6047
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

活跃 CTD 券情况

		收盘价	加权平均价	涨跌幅
2015-10-20	150011.IB	100.9250	100.2858	0.4246
	150003.IB	101.7037	101.6146	0.3565
2015-10-19	150011.IB	100.4983	100.1308	-0.0215
	150003.IB	101.3424	101.4279	-0.1593



金融市场隔夜要闻一览

- 1, **央行首发离岸债券 50 亿伦敦央票获 5 倍超额认购。**据彭博社报道，中国国家主席习近平对英国进行国事访问之际，人行在伦敦发行的 50 亿元人民币 1 年期央票据称获得了 300 亿元人民币的认购，这意味着央行首次试水离岸债券发行获得了成功，人民币国际化进程中也迎来了又一里程碑事件。
- 2, **中央高层 40 天内 7 谈股市 透露出两大信息。**继 9 月 9 日至 9 月 22 日，中央高层 5 次对股市发表谈话后，10 月 16 日、10 月 18 日，中央高层又对股市发表了两次谈话。在 40 天时间内，中央高层连续 7 次就股市发表谈话表明中央对继续培育公开透明、长期稳定健康发展的多层次资本市场的坚定决心，透露出“突出加强制度建设、完善风险管理”两大信息。
- 3, **人大校长陈雨露回短信确认：将调任央行副行长。**据媒体从多个信源获悉，中国人民大学校长陈雨露即将调任中国人民银行副行长。陈雨露在回复问询短信时，予以了确认。陈雨露于 2011 年 11 月起任中国人民大学校长，时年 45 岁的他在当时是中国最年轻的全国重点大学校长，位列副部级。目前，人民银行共有 4 位副行长：易纲、潘功胜、范一飞和郭庆平。其中，兼任国家外汇管理局局长的易纲分管外汇政策，潘功胜则分管征信。目前尚未获知陈雨露履新后将会分管哪些部门。
- 4, **方星海将任证监会副主席 曾称证监会主席最难做。**10 月 20 日消息 据悉，中财办国际经济局局长方星海将任证监会副主席。
- 5, **三季度大量新开账户或抄底 逾 30 只社保基金重仓股现身。**据中登公司于 8 月下旬发布的 7 月份统计月报显示，社保基金新开 46 个 A 股账户，其中沪深两市各新增社保基金账户 23 个，这也是去年 7 月以来首次新开账户，创下了 2008 年 11 月以来的单月开户历史纪录。至此，社保基金开立的 A 股账户总数达到了 310 个。

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