

 **金融期货晨报**

»»» 日期：2015年10月27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：**股票市场昨日小幅拉升，成交量保持稳定。受基本面制约，市场做多信心不足，缺乏热点板块，近期政府会议收到市场关注，短期反弹仍有空间，建议多单操作。

**国债期货：**国债期货昨日小幅震荡，成交量创近期新高。市场对未来利率走势分歧继续增大，财政政策加码概率扩大及货币政策宽松程度存在不确定性，期债不宜过分乐观，短期可能将维持震荡。建议短线做多。

# 金融期货主要数据一览

## 全球利率

	0/N	1W	1M	3M	6M	12M
Shibor	1.8400	2.3380	2.8880	3.0840	3.2980	3.3920
Tibor	-	0.1082	0.0000	0.1709	0.2573	0.2836
Libor 美元	0.1320	0.1563	0.1970	0.3199	0.5284	0.8342
Libor 英镑	0.4825	0.4866	0.5076	0.5794	0.7425	1.0315
Libor 欧元	-0.1829	-0.1650	-0.1321	-0.0529	0.0170	0.1217

## 全球汇率

	2015-10-26	2015-10-23	2015-10-22	2015-10-21	2015-10-20	2015-10-19
欧元中间价	7.005	7.0589	7.2006	7.2117	7.2061	7.2201
日元中间价	5.2438	5.2764	5.2965	5.294	5.3255	5.3203
美元中间价	6.3549	6.3595	6.3497	6.3473	6.3614	6.3527
美元指数	96.8048	97.0584	96.366	95.0499	94.8602	94.9176
欧元兑美元	1.1052	1.1014	1.1107	1.1338	1.1346	1.1328

## 各国股市概览

	收盘价	涨跌幅%		收盘价	涨跌幅%
道指	17623.05	-0.134	FTSE100	6417.02	-0.420
标普 500	2071.18	-0.191	日经 225	18947.12	0.647
德国 DAX	10801.34	0.063	上证综指	3429.5809	0.502
法国 CAC	4897.13	-0.538	深证成指	11687.772	0.727

## 国内金融期货前日涨跌

	收盘价	涨跌幅%	持仓量	成交量
IF1511	3470.2	0.527231	21617	13161
IF1512	3370	0.645084	19549	2415
TF1512	100.29	0.024934	18590	56190
T1512	99.245	0.035279	16414	21935

## 中债国债到期收益率

	1Y	3Y	5Y	7Y	10Y	15Y
2015-10-23	2.4454	2.7779	2.8865	3.0598	3.0400	3.3594
2015-10-22	2.4234	2.7827	2.8962	3.0744	3.0516	3.3554
2015-10-21	2.4273	2.7872	2.9087	3.0698	3.0616	3.3554
2015-10-20	2.4255	2.7920	2.9058	3.0796	3.0615	3.3553

## 市场资金加权平均利率

	R001. IB	R007. IB	GC001	GC007	IB0001	IB0007
2015-10-26	1.8436	2.4369	2.7127	2.6757	1.8796	2.4319
2015-10-23	1.9149	2.4465	3.9162	2.8462	1.9433	2.5007
2015-10-22	1.9117	2.4538	4.6707	2.5805	1.9312	2.4258
2015-10-21	1.9075	2.4295	2.2698	2.3841	1.9357	2.4661

## 活跃 CTD 券情况

		收盘价	加权平均价	涨跌幅
2015-10-26	150011.IB	101.0284	100.8864	0.0205
	150003.IB	101.8161	101.8173	-0.0033
2015-10-23	150011.IB	101.0077	100.8799	0.1255
	150003.IB	101.8195	101.682	0.1449

## 金融市场隔夜要闻一览

- 1, 十三五规划金融领域七大议题：发展多层次资本市场。**“十三五”有望完善中央银行利率调控体系，加强对市场预期的引导，强化价格型调控和传导机制，进一步完善人民币汇率形成机制，完善金融监管、发展普惠金融等。同时，“十三五”期间，金融改革可能会聚焦四方面业态：普惠金融、创业金融、互联网金融及绿色金融。
- 2, 十三五人口指标或下调 生育政策突破预期升温。**根据中央安排，10月26日，备受瞩目的十八届五中全会召开，会议将讨论十三五规划的建议，以此为基础制定的十三五规划纲要将要确定关于人口的2个关键指标，即2020年的人口总量指标和十三五（2016-2020年）的自然增长率指标。
- 3, 李克强时隔5年将再访韩 中方将推四大战略对接。**中国外交部副部长刘振民26日在北京透露，中国国务院总理李克强访韩期间，双方领导人将重点推动中国“大众创业、万众创新”与韩国“创造型经济”、中国“一带一路”与韩国“欧亚倡议”等两国四项发展战略实现对接。
- 4, 上交所：上市公司更改证券简称须“名副其实”。**10月26日，上交所对外发布四项临时公告格式指引，分别针对上市公司股票交易异常波动、签订战略框架协议、变更证券简称以及高送转等四类近期市场高度关注的事项，强化信息披露要求，加大监管力度。四项指引中，股票交易异常波动公告格式指引已沿用多年，本次主要是调整增加部分内容，其余三项公告格式指引则为新制订，其核心在于加大风险揭示力度、敦促公司如实披露具体信息。
- 5, 央行官员回应负利率区间：中国仍处于正利率时期。**10月26日，在中国国际经济交流中心举办的“经济每月谈”上，央行研究局局长陆磊正面回应了这一看法，若考虑PPI经济指标的话，中国依然保持很高的正利率。就在同一天，央行有关负责人就降息降准以及放开存款利率上限答记者问时强调，我国“双降”措施与国外央行采取的量化宽松政策（QE）有很大差别。国外实施QE的背景是名义政策利率已经触及“零”下界，而中国尚未面临“零利率”的约束，名义利率水平仍在“零”之上。

## 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