

 **金融期货晨报**

期 期 : 2015 年 10 月 29 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：**股票市场昨日震荡回落，成交量略有萎缩。受基本面制约，市场做多信心不足，缺乏热点板块，近期政府会议受到市场关注，更多实质性政策可能对市场信心产生积极影响，短期反弹仍有空间，建议多单操作。

**国债期货：**期债昨日午后迅速回落，成交量维持高位，T1512 临近 100 元关口，上方压力增大。近期市场对利率走势分歧加大，期债 IRR 水平转负，高位振幅加大，建议今日短线多单操作。



## 金融期货主要数据一览

### 全球利率

	0/N	1W	1M	3M	6M	12M
Shibor	1.7960	2.2920	2.7960	3.0380	3.2490	3.3710
Tibor	-	0.1082	0.0000	0.1709	0.2573	0.2836
Libor 美元	0.1315	0.1529	0.1936	0.3232	0.5317	0.8382
Libor 英镑	0.4825	0.4856	0.5066	0.5794	0.7413	1.0265
Libor 欧元	-0.1800	-0.1636	-0.1357	-0.0686	0.0014	0.0986

### 全球汇率

	2015-10-28	2015-10-27	2015-10-26	2015-10-23	2015-10-22	2015-10-21
欧元中间价	7.0103	7.021	7.005	7.0589	7.2006	7.2117
日元中间价	5.2754	5.253	5.2438	5.2764	5.2965	5.294
美元中间价	6.3536	6.3494	6.3549	6.3595	6.3497	6.3473
美元指数	97.6195	96.8792	96.8048	97.0584	96.366	95.0499
欧元兑美元	1.0925	1.1047	1.1052	1.1014	1.1107	1.1338

### 各国股市概览

	收盘价	涨跌幅%		收盘价	涨跌幅%
道指	17779.52	1.127	FTSE100	6437.8	1.139
标普 500	2090.35	1.184	日经 225	18903.02	0.671
德国 DAX	10831.96	1.307	上证综指	3375.1961	-1.722
法国 CAC	4890.58	0.898	深证成指	11494.347	-2.246

### 国内金融期货前日涨跌

	收盘价	涨跌幅%	持仓量	成交量
IF1511	3413	-1.925287	22408	14097
IF1512	3318	-1.851742	19493	2401
TF1512	100.215	-0.357942	18614	57376
T1512	99.39	-0.375883	18279	22024

## 中债国债到期收益率

	1Y	3Y	5Y	7Y	10Y	15Y
2015-10-28	2.3698	2.7247	2.8215	2.9949	2.9870	3.3063
2015-10-27	2.3748	2.7139	2.8112	2.9772	2.9800	3.2993
2015-10-26	2.4237	2.7533	2.8562	3.0156	3.0200	3.3393
2015-10-23	2.4454	2.7779	2.8865	3.0598	3.0400	3.3594

## 市场资金加权平均利率

	R001. IB	R007. IB	GC001	GC007	IB0001	IB0007
2015-10-28	1.7910	2.3440	2.1518	2.2978	1.8287	2.434
2015-10-27	1.7930	2.3513	2.3238	2.4679	1.8373	2.3892
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

## 活跃 CTD 券情况

		收盘价	加权平均价	涨跌幅
2015-10-28	150011.IB	101.1340	100.3743	-0.0852
	150003.IB	102.0152	102.0169	0.1967
2015-10-27	150011.IB	101.2202	100.911	0.1898
	150003.IB	101.8149	101.8167	-0.0012



## 金融市场隔夜要闻一览

- 1, **A 股企稳证监会走马换将 新班子频频下基层调研。**近日又报道称,中央财经领导小组办公室国际经济局(四局)局长方星海将接替临近退休的刘新华,任职证监会副主席。目前李超和方星海分工已经明确,李超主要分管机构部、私募部以及证券业协会、期货业协会和基金业协会;方星海主要分管国际部和会计部。
- 2, **再融资新政:不支持长期停牌 复牌后确定基准价。**管理层在北京召开保代培训会议,会上再融资审核政策做出相关调整,并指出以后券商内核负责把关,审核中不支持定价基准日前长期停牌的情况。
- 3, **中国国有企业负债 9 月暴涨 单月新增近 6 万亿元。**中国国有企业负债额 9 月出现暴涨,单月新增近 6 万亿元。这意味着,政府部门非但没有去杠杆,反而在加杠杆。按照安信证券分析师罗云峰形容,这是一种“空前的加杠杆”。财政部数据显示,截止 9 月末,国有企业负债总额 776827.6 亿元,较 8 月末暴增 5.93 万亿元。今年前九个月,国企新增负债总和超 11 万亿元。
- 4, **财政部将专项检查全国地方预决算公开情况。**财政部监督检查局 28 日发布消息,将对全国各地的地方预决算公开情况开展专项检查,检查结果将对社会公布。财政部表示,此举旨在贯彻落实《中华人民共和国预算法》《政府信息公开条例》《党政机关厉行节约反对浪费条例》以及财政部有关预决算公开工作文件要求,切实推进地方预决算公开工作,建立健全公开透明的预算制度。
- 5, **美债价格下挫 美联储保留了 12 月升息的可能性。**周三(10 月 28 日)美国公债价格下滑,中短期公债收益率触及一个月最高,之前美联储货币政策声明保留了 12 月升息的可能性,令原本预计不会暗示今年升息的交易商意外。

## 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