

 **金融期货晨报**

期 期：2015 年 11 月 20 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：昨日股票市场走高，但成交量继续萎缩，各板块均有上涨，市场资金宽裕，人气缓慢恢复，但疲弱的基本面抑制了市场信心，建议今日观望。

国债期货：期债昨日小幅上涨，12 月份合约成交量略有放大，持仓量大幅回落至 7000 手上方，主力换季完成，但主要投机资金仍于近季合约争夺。临近交割月，多空双方博弈增强，五债及十债持仓主力席位差别较大，当季与次季价差继续扩大。关注多空减仓和跨期价差。建议当季合约空单操作。

金融期货主要数据一览

全球利率

	0/N	1W	1M	3M	6M	12M
Shibor	1.7850	2.2800	2.6980	3.0440	3.1970	3.3500
Tibor	-	0.1082	0.0000	0.1709	0.2573	0.2836
Libor 美元	0.1310	0.1561	0.2068	0.3696	0.6060	0.9359
Libor 英镑	0.4819	0.4856	0.5091	0.5736	0.7306	1.0340
Libor 欧元	-0.1821	-0.1757	-0.1507	-0.0979	-0.0257	0.0700

全球汇率

	2015-11-19	2015-11-18	2015-11-17	2015-11-16	2015-11-13	2015-11-12
欧元中间价	6.8121	6.7862	6.8114	6.8349	6.8766	6.8467
日元中间价	5.1655	5.1706	5.1731	5.2054	5.1945	5.1804
美元中间价	6.3791	6.3796	6.374	6.375	6.3655	6.3628
美元指数	98.9779	99.5715	99.6525	99.3841	99.1003	98.5095
欧元兑美元	1.0733	1.0658	1.0643	1.0684	1.0729	1.0813

各国股市概览

	收盘价	涨跌幅%		收盘价	涨跌幅%
道指	17732.75	-0.025	FTSE100	6329.93	0.812
标普 500	2081.24	-0.112	日经 225	19859.81	1.072
德国 DAX	11085.44	1.145	上证综指	3617.062	1.362
法国 CAC	4915.1	0.171	深证成指	12609.844	2.655

国内金融期货前日涨跌

	收盘价	涨跌幅%	持仓量	成交量
IF1511	3698.8	-0.55	11702	10060
IF1512	3596.2	-0.87	28059	9451
TF1512	99.675	0.14	7476	53173
T1512	98.21	0.20	7889	14921

中债国债到期收益率

	1Y	3Y	5Y	7Y	10Y	15Y
2015-11-19	2.5948	2.8638	3.0021	3.1798	3.1402	3.4326
2015-11-18	2.5907	2.8375	3.0119	3.1599	3.1402	3.4326
2015-11-17	2.5911	2.8379	2.9948	3.1366	3.1252	3.4176
2015-11-16	2.6041	2.8314	2.9792	3.1307	3.1352	3.4277

市场资金加权平均利率

	R001. IB	R007. IB	GC001	GC007	IB0001	IB0007
2015-11-19	1.8013	2.3513	2.3296	2.3528	1.8075	2.417
2015-11-18	1.8005	2.3159	1.6889	2.1807	1.8112	2.4951
2015-11-17	1.8010	2.3663	1.8066	2.2026	1.8125	2.421
2015-11-16	1.7959	2.3448	1.9167	2.1635	1.8191	2.4172

活跃 CTD 券情况

		收盘价	加权平均价	涨跌幅
2015-11-18	150011.IB	100.4265	100.2236	-0.1895
	150003.IB	101.3970	101.4122	-0.1947
2015-11-17	150011.IB	100.6172	100.2589	0.2420
	150003.IB	101.5948	101.5526	0.1943

