

 **金融期货晨报**

期 期 : 2015 年 12 月 1 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：**周一大盘在银行板块带动下探底反弹，收盘勉强翻红，成交量萎缩。同时，IPO 临近将对市场短期资金流动性造成影响，疲弱的基本面抑制市场信心。建议观望。

**国债期货：**人民币成功纳入 SDR，离岸人民币美元升值，但贬值压力未减，央行未来对汇率干预力度将会减弱。临近 12 月，美联储可能的加息时点临近，近期利率存在回升压力。主力换季完成后，期债价格波动幅度将会降低，同时临近年底，市场静待政策方向的明确以及国际市场情况的进一步确认。建议今日观望。

# 金融期货主要数据一览

## 全球利率

	0/N	1W	1M	3M	6M	12M
Shibor	1.7880	2.2990	2.7000	3.0500	3.2000	3.3500
Tibor	-	0.1082	0.0000	0.1709	0.2573	0.2836
Libor 美元	0.1305	0.1552	0.2438	0.4142	0.6539	0.9739
Libor 英镑	0.4806	0.4859	0.5038	0.5700	0.7270	1.0265
Libor 欧元	-0.1850	-0.1764	-0.1643	-0.1179	-0.0500	0.0379

## 全球汇率

	2015-11-30	2015-11-27	2015-11-26	2015-11-25	2015-11-24	2015-11-23
欧元中间价	6.7673	6.7773	6.8076	6.801	6.7935	6.7894
日元中间价	5.2107	5.2117	5.2104	5.2148	5.1989	5.1985
美元中间价	6.3962	6.3915	6.3896	6.3877	6.3888	6.3867
美元指数	100.2351	100.0768	99.8394	99.7437	99.6308	99.7298
欧元兑美元	1.0564	1.0591	1.0609	1.0623	1.0642	1.0635

## 各国股市概览

	收盘价	涨跌幅%		收盘价	涨跌幅%
道指	17719.92	-0.441	FTSE100	6356.09	-0.299
标普 500	2080.41	-0.464	日经 225	19747.47	-0.686
德国 DAX	11382.23	0.783	上证综指	3445.40	0.265
法国 CAC	4957.6	0.557	深证成指	12037.86	0.637

## 国内金融期货前日涨跌

	收盘价	涨跌幅%	持仓量	成交量
IF1512	3485.8	-0.04	36840	18161
IF1603	3321	0.18	2991	925
TF1603	100.135	0.21	20514	34057
T1603	99.015	0.36	23604	14663

## 中债国债到期收益率

	1Y	3Y	5Y	7Y	10Y	15Y
2015-11-30	2.5754	2.8277	2.8843	3.0475	3.0404	3.3630
2015-11-27	2.5738	2.8336	2.9005	3.0799	3.0603	3.3830
2015-11-26	2.5639	2.8513	2.9090	3.0899	3.0503	3.3730
2015-11-25	2.5802	2.8600	2.9410	3.1299	3.0853	3.3777

## 市场资金加权平均利率

	R001. IB	R007. IB	GC001	GC007	IB0001	IB0007
2015-11-30	1.8085	2.4129	3.3967	3.5117	1.8089	2.4212
2015-11-27	1.7992	2.4109	2.0184	3.3285	1.8142	2.5140
2015-11-26	1.7978	2.4235	2.4313	2.9010	1.7983	2.4252
2015-11-25	1.7976	2.3641	1.3203	2.3000	1.8105	2.3372

## 活跃 CTD 券情况

		收盘价	加权平均价	涨跌幅
2015-11-30	150011.IB	100.9031	100.4274	-0.0006
	150003.IB	101.5831	101.5861	0.0042
2015-11-27	150011.IB	100.9037	100.299	0.1231
	150003.IB	101.5788	101.5868	-0.0078



## 金融市场隔夜要闻一览

- 1, **IMF 宣布将人民币纳入 SDR。**国际货币基金组织 (IMF) 11 月 30 日宣布将人民币作为除英镑、欧元、日元和美元之外的第五种货币纳入特别提款权 (SDR) 货币篮子。这是人民币国际化的里程碑时刻, 意味着人民币已成为全球主要储备货币。
- 2, **人民币加入 SDR 离岸人民币美元涨 欧元英镑跌。**由于人民币的加入, 美元、欧元、日元和英镑的权重均较此前有所下调。其中, 美元调降幅度最小, 仅为 0.2 个百分点, 从 41.9% 降至 41.7%; 欧元降幅较大, 从 37.4% 降至 30.9%; 英镑降幅也颇大, 从 11.3% 降至 8.1%, 权重低于日元, 而此前英镑权重是高于日元的; 日元比重从 9.4% 降至 8.3%。消息公布后, 离岸人民币短线上涨, 美元因权重变化不大而走高, 欧元和英镑因权重下调较大而走低。
- 3, **中央经济工作会议召开在即 供给侧改革将成政策重点。**2015 行至 12 月, 按照正常节奏, 中央经济工作会议将在本月中旬前后召开, 确定明年经济的调控基调, 并明确财政和货币政策搭配。一位接近决策层的不愿具名的人士告诉《每日经济新闻》记者, 2016 年是“十三五”开局之年, 中国经济已经进入深度调整期和转型期的关键之年, 很多问题和矛盾 2015 年已经显性化, 新产业和新方向也有建树, 明年经济的基调如何很值得期待。
- 4, **韩国国会表决通过中韩自贸协定批准案。**中新社首尔 11 月 30 日电韩国国会于当地时间 30 日下午 5 时许, 以 196 票赞成、33 票反对、36 票弃权的表决结果通过了中韩自由贸易协定 (FTA) 批准案。
- 5, **百城住宅均价连续 4 个月双涨 深圳同比大涨 34.75%。**11 月全国房价整体仍呈平稳回升态势。中国指数研究院发布的 11 月百城价格指数显示, 2015 年 11 月, 全国 100 个城市新建住宅平均价格为 10899 元/平方米, 环比上涨 0.46%, 涨幅较上月扩大 0.16 个百分点; 比上月上涨 2.93%, 涨幅较上月扩大 0.86 个百分点。百城房价连续 4 个月环比、同比双涨。

## 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