

 **金融期货晨报**

期 期：2015 年 12 月 11 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：股票市场弱势震荡，成交量萎缩，上证指数于 5 日均线下方弱势运行。注册制、IPO 及美联储加息等利空因素云集，加大市场压力。存量资金博弈为主，增量资金较有限的情况下，市场仍缺乏热点，信心脆弱。建议观望**

**国债期货：期债窄幅震荡，午后出现跳水，交易活跃度降低，市场观望气氛渐浓。临近周末，市场静待央行动作及对未来政策表态，美联储加息、IPO 规模等利空因素仍未落地。建议观望为主。**

# 金融期货主要数据一览

## 全球利率

	0/N	1W	1M	3M	6M	12M
Shibor	1.7890	2.2970	2.7010	3.0460	3.2000	3.3500
Tibor	-	0.1082	0.0000	0.1709	0.2573	0.2836
Libor 美元	0.1295	0.1755	0.3005	0.4920	0.7297	1.0525
Libor 英镑	0.4806	0.4844	0.5029	0.5778	0.7414	1.0465
Libor 欧元	-0.2736	-0.2536	-0.1907	-0.1143	-0.0321	0.0629

## 全球汇率

	2015-12-10	2015-12-9	2015-12-8	2015-12-7	2015-12-4	2015-12-3
欧元中间价	7.0674	6.982	6.9399	6.9568	6.9769	6.7867
日元中间价	5.2792	5.216	5.199	5.1971	5.2063	5.1958
美元中间价	6.4236	6.414	6.4078	6.3985	6.3851	6.3982
美元指数	97.9263	97.343	98.4238	98.7079	98.3092	97.8693
欧元兑美元	1.0941	1.1026	1.0891	1.0837	1.0874	1.094

## 各国股市概览

	收盘价	涨跌幅%		收盘价	涨跌幅%
道指	17574.75	0.471	FTSE100	6088.05	-0.631
标普 500	2052.23	0.225	日经 225	19046.55	-1.319
德国 DAX	10598.93	0.061	上证综指	3455.50	-0.488
法国 CAC	4635.06	-0.052	深证成指	12181.03	0.010

## 国内金融期货前日涨跌

	收盘价	涨跌幅%	持仓量	成交量
IF1512	3567	-0.66	31831	16540
IF1603	3370	-0.82	3913	1017
TF1603	100.18	-0.03	20062	27347
T1603	99.105	-0.08	23965	16452

## 中债国债到期收益率

	1Y	3Y	5Y	7Y	10Y	15Y
2015-12-10	2.4841	2.7115	2.8277	3.0025	3.0018	3.3259
2015-12-9	2.4866	2.7106	2.8226	3.0050	2.9968	3.3209
2015-12-8	2.4911	2.7099	2.8393	3.0199	3.0005	3.3246
2015-12-7	2.5201	2.7242	2.8651	3.0399	3.0280	3.3521

## 市场资金加权平均利率

	R001. IB	R007. IB	GC001	GC007	IB0001	IB0007
2015-12-10	1.7987	2.4555	2.6477	2.7282	1.8169	2.5516
2015-12-9	1.8041	2.4148	1.6135	2.5152	1.8238	2.6211
2015-12-8	1.8013	2.3945	1.5586	2.3091	1.8214	2.4688
2015-12-7	1.8033	2.3875	1.7911	2.1524	1.8215	2.4190

## 活跃 CTD 券情况

		收盘价	加权平均价	涨跌幅
2015-12-10	150011.IB	100.3068	100.3083	-0.8504
	150003.IB	102.0453	101.9433	0.2003
2015-12-9	150011.IB	101.1671	100.342	-0.0030
	150003.IB	101.8413	101.9898	-0.1241

## 金融市场隔夜要闻一览

- 1, **复星郭广昌确认失联 王宗南或交待重大线索**。12月10日晚,报道称,复星集团董事长郭广昌确已失联,尚不清楚是接受调查还是协助调查。
- 2, **瑞士央行维持存款利率不变 保持在纪录低位**。北京时间10日下午瑞士央行将利率维持在纪录低位不变,并继续承诺将在必要时继续干预外汇市场,帮助“高估”的瑞郎抵御压力。由 Thomas Jordan 担任行长的瑞士央行将活期存款利率维持在-0.75%,符合接受彭博调查的19位经济学家中15人的预测。瑞士央行还将3个月伦敦银行同业拆借利率(Libor)目标区间维持在-1.25至-0.25%不变。
- 3, **中国与格鲁吉亚正式启动双边自由贸易协定谈判**。12月10日,商务部国际贸易谈判代表兼副部长钟山与格鲁吉亚经济与可持续发展部长库姆西什维利在中格政府间经贸合作委员会第七次会议会后,签署了《中华人民共和国商务部和格鲁吉亚经济与可持续发展部关于启动中格自由贸易协定谈判的谅解备忘录》,正式启动中格自贸协定谈判。
- 4, **上海深化证照分离改革 方案近期将上报国务院**。上海自贸区管委会副主任朱民表示,关于深化“证照分离”的改革试点,上海已经制定形成了改革的方案,近期就将上报国务院。11月25日考察上海自贸区的时候,国务院总理李克强对上海市负责人说,你们提出开展“证照分离”试验,要尽快给国务院报方案。在一些易操作、可管理的领域先行展开。
- 5, **今年地方债已发行 3.83 万亿 陕西本月还将发债**。甘肃省10日公开招标发行了四期共52.7亿元的一般地方债,中标利率较下限纷纷上浮29bp或30bp。甘肃省昨日招标的该省今年第四批地方政府一般债券,包含3年、5年、7年、10年期4支固息债券,计划发行总额为52.7亿元。据招投标书披露,此次3至10年期债券招标利率区间分别为2.71%-3.12%、2.85%-3.28%、3.03%-3.48%、3.02%-3.47%。公告披露,此次甘肃4支一般地方债中标利率分别落于3%、3.15%、3.33%、3.32%,分别较各自招标下限高出29bp、30bp、30bp、30bp;其中标利率相对招标下限的上浮幅度,比较接近8日辽宁省发行的同类债券。而据Wind数据统计,截至12月10日,今年已发行地方政府债券3.8267亿元;本月15日,陕西省还将发行52.9亿元一般地方债。

## 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**

杭州营业部地址	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