

 **金融期货晨报**

期 期 : 2015 年 12 月 16 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：昨日股票市场窄幅震荡，上证指数收盘站住 3500 点。多项改革细项落地，11 月经济数据有所企稳，短期 IPO 也未能阻止市场乐观情绪升温。但目前经济仍存在较大困难，过剩产能需要时间出清，短期企稳仍有不确定性，观望为主。

国债期货：期债小幅反弹，成交量略有萎缩，国债现券收益率略有回升，市场对未来政策及经济情况分歧逐步加大。临近年末，各项经济金融数据陆续公布，政府明年经济工作逐步清晰，多空双方争夺开始激烈。建议观望。

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	2.7210	3.0510	3.2000	3.3500
Tibor	-	0.1082	0.0000	0.1709	0.2573	0.2836
Libor 美元	0.1350	0.2988	0.3445	0.5178	0.7485	1.0643
Libor 英镑	0.4806	0.4844	0.5029	0.5846	0.7444	1.0551
Libor 欧元	-0.2764	-0.2679	-0.1957	-0.1236	-0.0293	0.0600

全球汇率

	2015-12-15	2015-12-14	2015-12-11	2015-12-10	2015-12-9	2015-12-8
欧元中间价	7.0972	7.0807	7.0388	7.0674	6.982	6.9399
日元中间价	5.3321	5.3343	5.2855	5.2792	5.216	5.199
美元中间价	6.4559	6.4495	6.4358	6.4236	6.414	6.4078
美元指数	98.1777	97.6446	97.5761	97.9263	97.343	98.4238
欧元兑美元	1.0928	1.0993	1.0993	1.0941	1.1026	1.0891

各国股市概览

	收盘价	涨跌幅%		收盘价	涨跌幅%
道指	17524.91	0.901	FTSE100	6017.79	2.447
标普 500	2043.41	1.062	日经 225	18565.9	-1.681
德国 DAX	10450.38	3.068	上证综指	3510.35	-0.293
法国 CAC	4614.4	3.160	深证成指	12495.25	0.763

国内金融期货前日涨跌

	收盘价	涨跌幅%	持仓量	成交量
IF1512	3670.4	-0.69	21097	14496
IF1603	3493.6	-0.13	4323	773
TF1603	100.2	0.12	19802	22243
T1603	99.085	0.21	23931	15886

中债国债到期收益率

	1Y	3Y	5Y	7Y	10Y	15Y
2015-12-15	2.4474	2.7387	2.8263	3.0150	3.0157	3.3398
2015-12-14	2.4523	2.7333	2.8434	3.0300	3.0306	3.3547
2015-12-11	2.4644	2.7060	2.8178	2.9907	2.9931	3.3172
2015-12-10	2.4841	2.7115	2.8277	3.0025	3.0018	3.3259

市场资金加权平均利率

	R001. IB	R007. IB	GC001	GC007	IB0001	IB0007
2015-12-15	1.8014	2.4351	3.8144	2.8236	1.8243	2.4808
2015-12-14	1.8065	2.4434	4.4081	2.7838	1.8296	2.5217
2015-12-11	1.7985	2.4433	2.8363	2.8628	1.8381	2.5893
2015-12-10	1.7987	2.4555	2.6477	2.7282	1.8169	2.5516

活跃 CTD 券情况

		收盘价	加权平均价	涨跌幅
2015-12-15	150011.IB	101.2279	100.3520	0.1434
	150003.IB	102.0777	101.9594	-0.0029
2015-12-14	150011.IB	101.0829	100.4809	-0.1446
	150003.IB	102.0807	102.0585	0.2392

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