

# 金融期货晨报

日期：2015年12月21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：**上周股票市场震荡上行，成交量放大，上证指数收于 3578.96 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，短期继续上行存在较大不确定性，观望为主。

**国债期货：**国债期货周五出现上冲，成交量小幅增加。年内出台强刺激可能性低，经济改革加强对供给端调整结构，同时已公布的数据均显示我国经济增速放缓及通缩压力较大，这使得未来国债收益率下行条件仍存，但货币政策刺激减弱的预期也使得收益率下方空间更加有限。。随着更多经济数据和政策信息的释放，市场对未来预期的博弈增强，主力合约波动加大。密切关注近期数据，多单短线操作。

# 金融期货主要数据一览

## 全球利率

	0/N	1W	1M	3M	6M	12M
Shibor	1.8160	2.3180	2.8220	3.0501	3.2000	3.3500
Tibor	-	0.1082	0.0000	0.1709	0.2573	0.2836
Libor 美元	0.3614	0.3730	0.4021	0.5695	0.7950	1.1090
Libor 英镑	0.4806	0.4872	0.5035	0.5853	0.7461	1.0562
Libor 欧元	-0.2807	-0.2679	-0.1986	-0.1236	-0.0314	0.0579

## 全球汇率

	2015-12-18	2015-12-17	2015-12-16	2015-12-15	2015-12-14	2015-12-11
欧元中间价	7.0267	7.0383	7.0647	7.0972	7.0807	7.0388
日元中间价	5.2962	5.2901	5.311	5.3321	5.3343	5.2855
美元中间价	6.4814	6.4757	6.4626	6.4559	6.4495	6.4358
美元指数	98.7112	99.0758	98.3706	98.1777	97.6446	97.5761
欧元兑美元	1.0866	1.0827	1.0911	1.0928	1.0993	1.0993

## 各国股市概览

	收盘价	涨跌幅%		收盘价	涨跌幅%
道指	17128.55	-2.099	FTSE100	6052.42	-0.821
标普 500	2005.55	-1.780	日经 225	18986.8	-1.895
德国 DAX	10608.19	-1.210	上证综指	3578.96	-0.029
法国 CAC	4625.26	-1.118	深证成指	12830.25	0.037

## 国内金融期货前日涨跌

	收盘价	涨跌幅%	持仓量	成交量
IF1601	3704.8	0.80	25664	14278
IF1603	3596	0.58	5025	946
TF1603	100.62	0.38	23911	34667
T1603	99.56	0.40	23832	20000

## 中债国债到期收益率

	1Y	3Y	5Y	7Y	10Y	15Y
2015-12-18	2.3647	2.6660	2.7344	2.9500	2.9408	3.2651
2015-12-17	2.3907	2.6961	2.7667	2.9900	2.9857	3.3100
2015-12-16	2.4028	2.7292	2.8200	2.9907	3.0007	3.3248
2015-12-15	2.4474	2.7387	2.8263	3.0150	3.0157	3.3398

## 市场资金加权平均利率

	R001. IB	R007. IB	GC001	GC007	IB0001	IB0007
2015-12-18	1.8406	2.4541	2.7131	2.9113	1.8602	2.5833
2015-12-17	1.8088	2.4727	3.1775	2.6727	1.8156	2.5782
2015-12-16	1.8035	2.4217	2.1931	2.4787	1.8136	2.5153
2015-12-15	1.8014	2.4351	3.8144	2.8236	1.8243	2.4808

## 活跃 CTD 券情况

		收盘价	加权平均价	涨跌幅
2015-12-18	150011.IB	101.5155	100.6126	0.0797
	150003.IB	102.1755	102.1818	0.1782
2015-12-17	150011.IB	101.4347	100.377	0.2669
	150003.IB	101.9937	101.9949	0.0205

## 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