

 **金融期货晨报**

期 期 : 2015 年 12 月 22 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：**股票市场继续上行，成交量放大，上证指数站上 3600 点，蓝筹板块涨幅靠前。中央经济工作会议举行，多项改革细项落地，财政政策将加大力度，市场对明年改革部署给予较高期待。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，谨慎做多。

**国债期货：**昨日期债继续震荡上行，成交量进一步放大。银行间国债收益率继续下行，活跃 CTD 券跌破 3%位置，IRR 保持 0-1.5%合理区间。上周末央行进行 6 个月期 MLF 操作，具体数量未知。年末银行间市场表现来看，市场对明年降准给予更多期待，但仍需关注明年债务供给压力及中长期期限利差情况。建议 100 元下方日内多单操作。

# 金融期货主要数据一览

## 全球利率

	0/N	1W	1M	3M	6M	12M
Shibor	1.8430	2.3340	2.8910	3.0551	3.2000	3.3503
Tibor	-	0.1082	0.0000	0.1709	0.2573	0.2836
Libor 美元	0.3658	0.3864	0.4130	0.5855	0.8070	1.1143
Libor 英镑	0.4819	0.4844	0.5019	0.5856	0.7474	1.0578
Libor 欧元	-0.2800	-0.2686	-0.1993	-0.1243	-0.0293	0.0579

## 全球汇率

	2015-12-21	2015-12-18	2015-12-17	2015-12-16	2015-12-15	2015-12-14
欧元中间价	7.042	7.0267	7.0383	7.0647	7.0972	7.0807
日元中间价	5.3405	5.2962	5.2901	5.311	5.3321	5.3343
美元中间价	6.4753	6.4814	6.4757	6.4626	6.4559	6.4495
美元指数	98.4536	98.7112	99.0758	98.3706	98.1777	97.6446
欧元兑美元	1.0914	1.0866	1.0827	1.0911	1.0928	1.0993

## 各国股市概览

	收盘价	涨跌幅%		收盘价	涨跌幅%
道指	17251.62	0.72	FTSE100	6034.84	-0.29
标普 500	2021.15	0.78	日经 225	18916.02	-0.373
德国 DAX	10497.77	-1.04	上证综指	3642.47	1.774
法国 CAC	4565.17	-1.3	深证成指	13028.31	1.544

## 国内金融期货前日涨跌

	收盘价	涨跌幅%	持仓量	成交量
IF1601	3800.2	2.70	27544	14845
IF1603	3704.4	3.19	5244	1202
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
2015-12-21	2.3601	2.5836	2.6996	2.8653	2.8811	3.2353
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

## 市场资金加权平均利率

	R001. IB	R007. IB	GC001	GC007	IB0001	IB0007
2015-12-21	1.8676	2.4606	2.5589	2.9414	1.8724	2.5539
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

## 活跃 CTD 券情况

		收盘价	加权平均价	涨跌幅
2015-12-21	150011.IB	101.7232	100.3906	0.2046
	150003.IB	102.3456	102.3300	0.1665
2015-12-18	150011.IB	101.5155	100.6126	0.0797
	150003.IB	102.1755	102.1818	0.1782

## 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