

 **金融期货晨报**

期 期：2015 年 12 月 24 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：昨日大盘冲高回落，在金融板块带领下，沪指创出近期新高，但尾盘迅速回落翻绿。中央经济工作会议多项改革细项落地，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：昨日期债震荡上行，收盘未站上 100 元位置。银行间国债收益率下行受阻，市场资金利率出现回升，资金季节性紧张显现。期限利差继续收窄，10 年期与 7 年期出现倒挂，曲线平坦化使得 10 债上行压力加大，短端收益率缺乏明显下行动力。暂时观望。

金融期货主要数据一览

全球利率

	0/N	1W	1M	3M	6M	12M
Shibor	1.9030	2.3480	2.9870	3.0735	3.2000	3.3500
Tibor	-	0.1082	0.0000	0.1709	0.2573	0.2836
Libor 美元	0.3674	0.3900	0.4175	0.5944	0.8195	1.1310
Libor 英镑	0.4806	0.4847	0.5048	0.5859	0.7452	1.0559
Libor 欧元	-0.2779	-0.2686	-0.2021	-0.1264	-0.0379	0.0593

全球汇率

	2015-12-23	2015-12-22	2015-12-21	2015-12-18	2015-12-17	2015-12-16
欧元中间价	7.09	7.0659	7.042	7.0267	7.0383	7.0647
日元中间价	5.3492	5.3447	5.3405	5.2962	5.2901	5.311
美元中间价	6.4731	6.4746	6.4753	6.4814	6.4757	6.4626
美元指数	98.3578	98.1859	98.4536	98.7112	99.0758	98.3706
欧元兑美元	1.0909	1.0956	1.0914	1.0866	1.0827	1.0911

各国股市概览

	收盘价	涨跌幅%		收盘价	涨跌幅%
道指	17602.61	1.064	FTSE100	6240.98	2.595
标普 500	2064.29	1.242	日经 225	-	0.000
德国 DAX	10727.64	2.278	上证综指	3636.09	-0.429
法国 CAC	4674.53	2.341	深证成指	13007.87	-0.999

国内金融期货前日涨跌

	收盘价	涨跌幅%	持仓量	成交量
IF1601	3805	-0.07	28579	15306
IF1603	3708	-0.11	5217	1108
TF1603	100.775	-0.02	24098	26411
T1603	99.905	0.07	24326	20619

中债国债到期收益率

	1Y	3Y	5Y	7Y	10Y	15Y
2015-12-23	2.3332	2.5722	2.6794	2.8415	2.8460	3.2003
2015-12-22	2.3204	2.5761	2.6629	2.8529	2.8610	3.2153
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

市场资金加权平均利率

	R001. IB	R007. IB	GC001	GC007	IB0001	IB0007
2015-12-23	1.9253	2.4142	5.1085	3.4326	1.9331	2.5691
2015-12-22	1.8986	2.4627	3.5759	3.2926	1.9148	2.7766
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

活跃 CTD 券情况

		收盘价	加权平均价	涨跌幅
2015-12-23	150011.IB	101.8047	100.5836	0.0811
	150003.IB	102.6154	102.6168	0.0835
2015-12-22	150011.IB	101.7222	100.5415	-0.0010
	150003.IB	102.5298	102.5313	0.1800

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	衢州市县西街73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 0574-87207187	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1505室	电话 0579-82983171	邮编 321001