

 **金融期货晨报**

期 期 : 2015 年 12 月 28 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：昨日受到个人外汇监管新规即将实施消息的冲击，沪 B 股指数走出 4 个月来单日最大跌幅。午后大盘大幅下挫，金融、有色、房地产等板块跌幅靠前。近期减持禁令将解除，减持将对股票市场形成冲击，同时注册制的确定也对市场跳水造成影响。短期利空压制市场反弹，但对基本面并无持续影响，今日多单操作。

国债期货：昨日期债低开高走，T1603 再创新高，TF1603 也逼近前期高点，前期收益率大幅回落至历史次低位，盘面有技术性调整需要，银行间市场国债收益率下行受阻，市场短期资，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	1.9340	2.3550	3.0040	3.0825	3.2000	3.3500
Tibor	-	0.1082	0.0000	0.1709	0.2573	0.2836
Libor 美元	0.3671	0.3897	0.4219	0.6031	0.8273	1.1475
Libor 英镑	0.4819	0.4853	0.5038	0.5879	0.7484	1.0612
Libor 欧元	-0.2814	-0.2486	-0.2043	-0.1271	-0.0379	0.0593

全球汇率

	2015-12-25	2015-12-24	2015-12-23	2015-12-22	2015-12-21	2015-12-18
欧元中间价	7.0939	7.0665	7.09	7.0659	7.042	7.0267
日元中间价	5.3853	5.3555	5.3492	5.3447	5.3405	5.2962
美元中间价	6.4713	6.4755	6.4731	6.4746	6.4753	6.4814
美元指数	97.8487	97.939	98.3578	98.1859	98.4536	98.7112
欧元兑美元	1.0973	1.096	1.0909	1.0956	1.0914	1.0866

各国股市概览

	收盘价	涨跌幅%		收盘价	涨跌幅%
道指	17552.17	-0.287	FTSE100	6254.64	0.219
标普 500	2060.99	-0.160	日经 225	18769.06	-0.110
德国 DAX	10727.64	2.28	上证综指	3627.91	0.427
法国 CAC	4663.18	-0.243	深证成指	12980.57	0.373

国内金融期货前日涨跌

	收盘价	涨跌幅%	持仓量	成交量
IF1601	3806.8	0.82	28638	12153
IF1603	3712.2	0.78	5377	926
TF1603	100.86	-0.08	24637	27792
T1603	100.26	-0.01	26222	20146

中债国债到期收益率

	1Y	3Y	5Y	7Y	10Y	15Y
2015-12-25	2.2946	2.5694	2.6565	2.8102	2.8061	3.1604
2015-12-24	2.3135	2.5603	2.6630	2.8050	2.8010	3.1553
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

市场资金加权平均利率

	R001. IB	R007. IB	GC001	GC007	IB0001	IB0007
2015-12-25	1.9517	2.4918	3.6836	4.0388	1.9679	2.5647
2015-12-24	1.9475	2.3746	6.2198	3.8647	1.9678	2.4797
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

活跃 CTD 券情况

		收盘价	加权平均价	涨跌幅
2015-12-25	150011.IB	99.9100	101.0584	-1.8611
	150003.IB	102.6376	102.6416	0.0451
2015-12-24	150011.IB	101.8047	100.9658	0.0000
	150003.IB	102.5913	102.5926	-0.0235

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	山东省济南市历下区文化西路13号海辰办公写字楼1-1004	电话:0531-55638701	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1104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