

定期报告

金融期货日报

2015年8月13日星期四

近期汇率为市场热点，建议震荡思路

行情综述

今日三指数收涨。其中，沪深300期指收于4015.6点，涨38.2点，涨幅0.96%；上证50期指收于2553.2点，涨0.4点，涨幅0.02%；中证500期指收于8345.8点，涨209.4点，涨幅2.57%。

五年期国债期货主力TF1509收盘涨0.04%，结算价96.575，成交量4542，增仓-947；十年主力T1509收盘涨0.061%，结算价95.325，成交量1660，增仓-387。

操作建议

股指期货：

人民币兑美元中间价再将逾千点，中国央行首席经济学家马骏称央行有能力稳定人民币汇率；外汇局称要求银行限制企业集中大额购汇；人民币贬值或令美联储推后加息；新华社述评称人民币贬值不会引起货币战；昨日天津滨海新区危险品集装箱爆炸；周三沪深两市净流入资金518.72亿元，资金面及消息面均偏空，建议震荡偏空思路或多IC空IH组合。。

国债期货：

央行引导长端利率下行意图明显，期债走牛已可期。近期的股市大幅下跌使市场避险情绪升温，打新资金、银行理财等资金将向固定收益类倾斜。期债长期依旧看多，建议多单继续持有，做好止损，防止快速上涨后的极端回调。另关注银行间流动性指标，若流动性由松变紧，果断减、平仓。



国都期货研究所

王伊凡

电话：010-84183098

邮件：wangyifan@guodu.cc

执业证书编号：F0284395

投资咨询从业资格号：

Z0010570

今日资讯

【中国央行新闻稿】

保持人民币汇率在合理均衡水平上的基本稳定。

将维护汇率的正常浮动；将进一步完善人民币汇率市场化形成机制。

仍将坚持实施稳健的货币政策。

中国央行公开市场今日将进行 400 亿元 7 天期逆回购操作。

另外，今日有 350 亿元逆回购到期。

央行公开市场本周净投放 50 亿元，上周净回笼 50 亿元。

【外媒：央行指导大行固定点位干预】

据外媒援引消息人士称，针对短期汇率市场可能存在的情绪性波动，中国央行已窗口指导国内大型银行，明确要求大行以外汇代持方式在固定点位入场接盘，以避免市场出现连续性大幅波动。

【天津港危险品仓库发生爆炸事故】

据天津市政府微博，8 月 12 日晚 11:20 左右，天津港国际物流中心区域内瑞海公司所属危险品仓库(系民营企业)发生爆炸。目前，经初步核查，7 人死亡，部分人员受伤，周边建筑受损。在灭火过程中发生 2 次爆炸，导致部分现场人员被困，正在全力搜救。

【美国经济数据】

美国 7 月零售销售环比 0.6%，预期 0.6%，前值-0.3%。

美国 7 月零售销售(除汽车)环比 0.4%，预期 0.4%，前值从-0.1%修正为 0.4%。

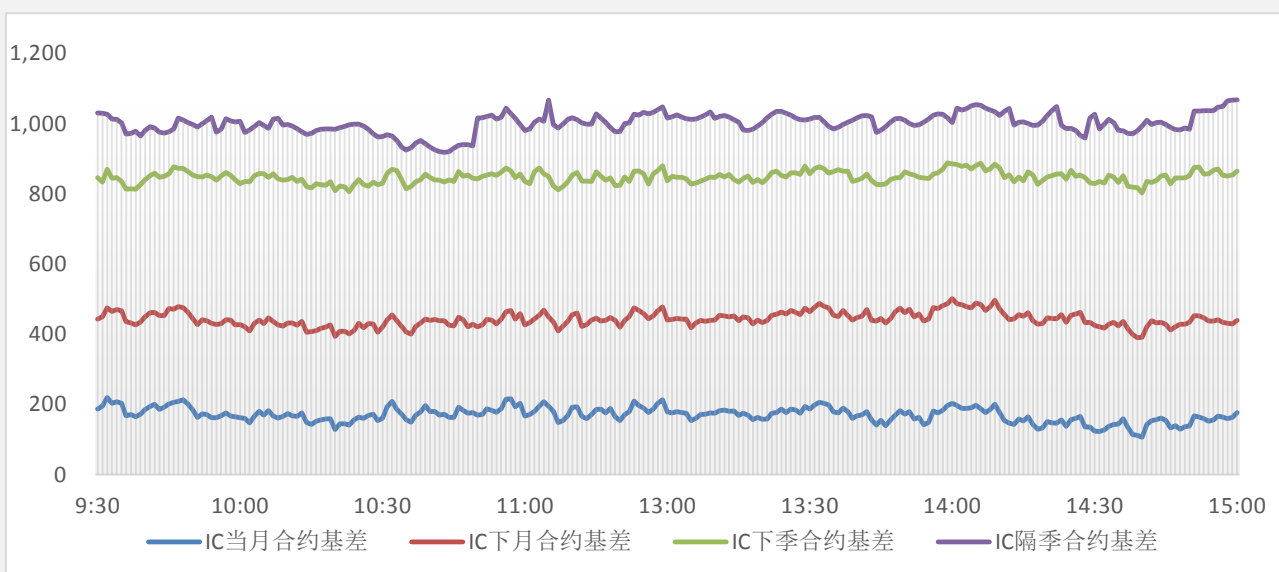
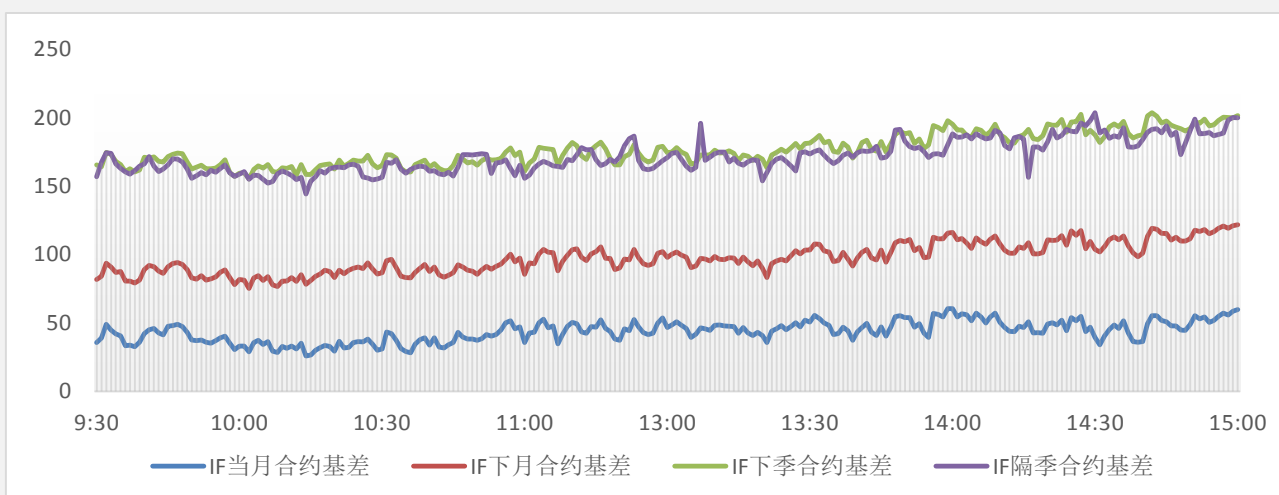
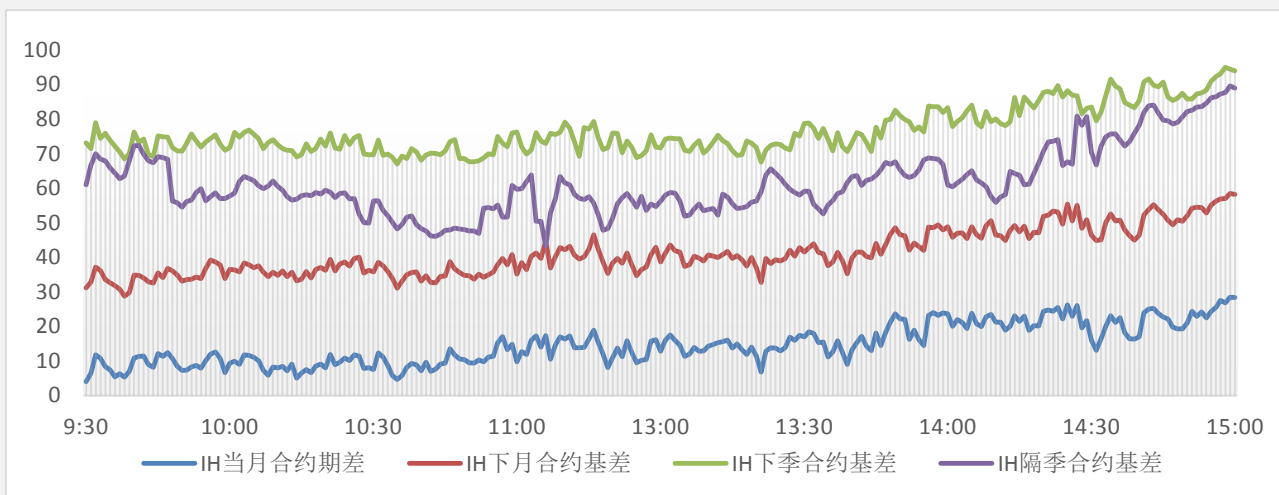
美国 7 月零售销售(除汽车与汽油)环比 0.4%，预期 0.4%，前值从-0.2%修正为 0.2%。

【国土部全面启动不动产登记信息平台建设】

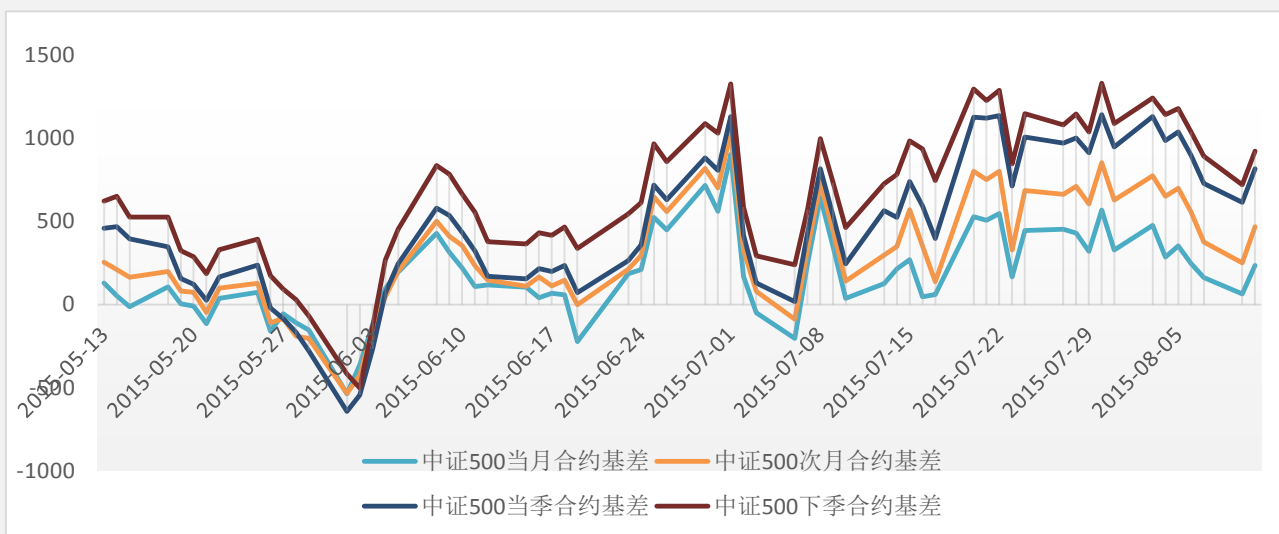
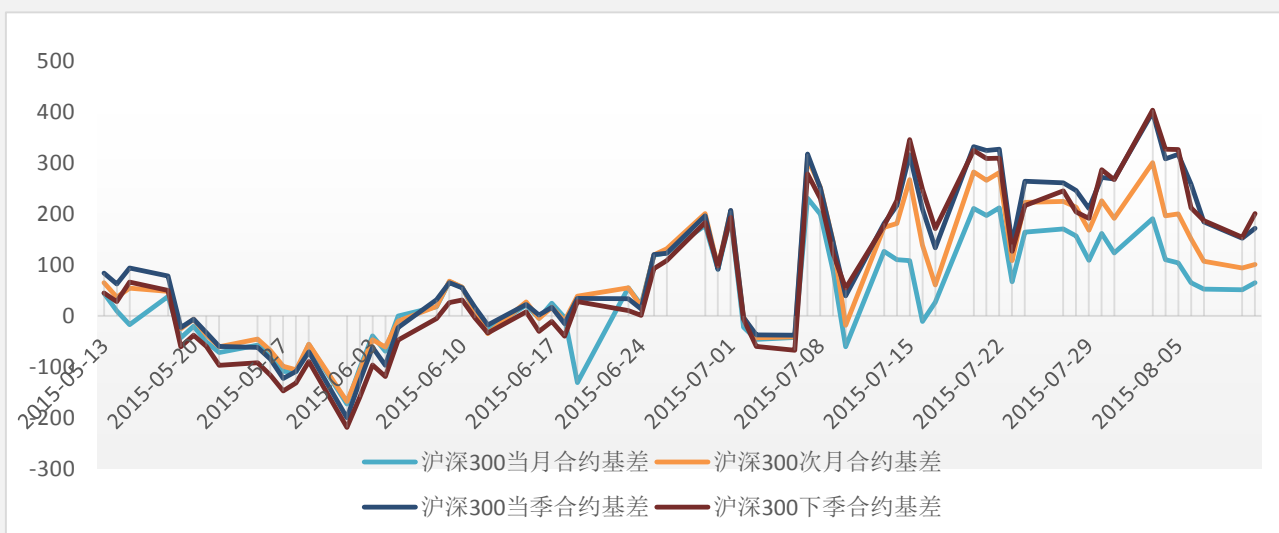
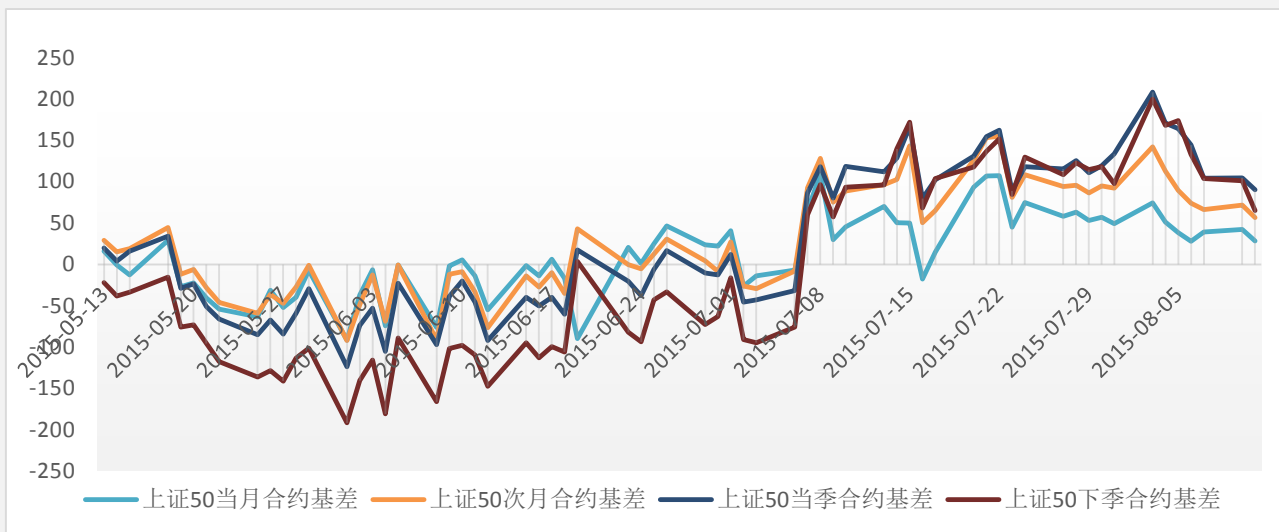
国土资源部印发《关于做好不动产登记信息管理基础平台建设工作通知》，通知要求把不动产登记信息平台搭建在“国土资源云”上，今年下半年实现信息平台上线试运行，2016 年基本完成数据整合建库，2017 年基本建成覆盖全国的信息平台。

股指期货关键数据跟踪

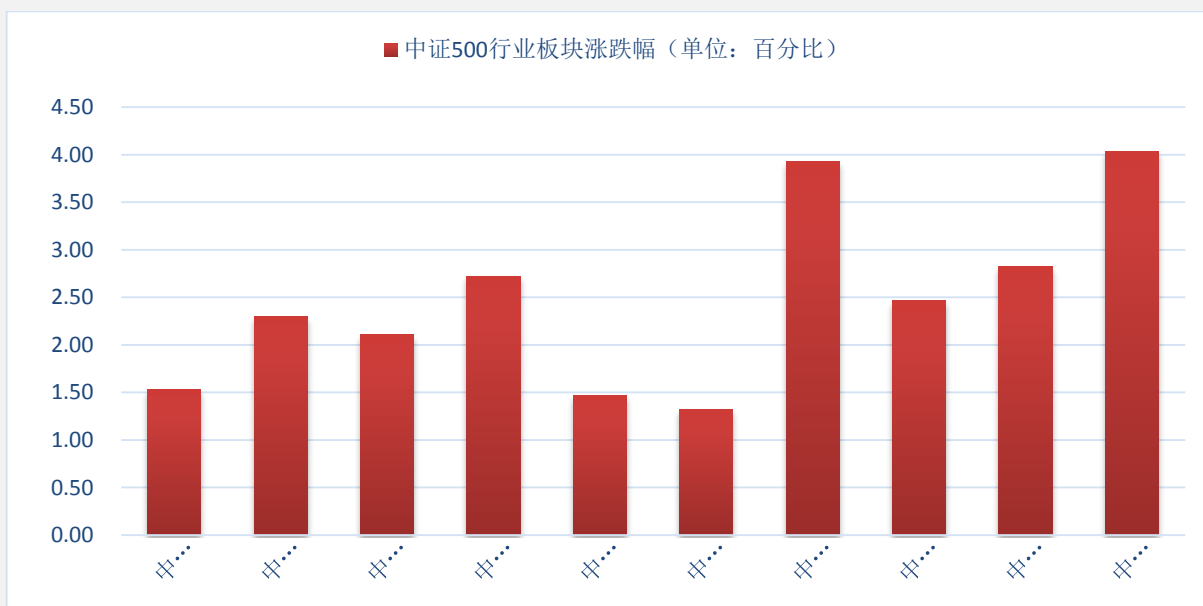
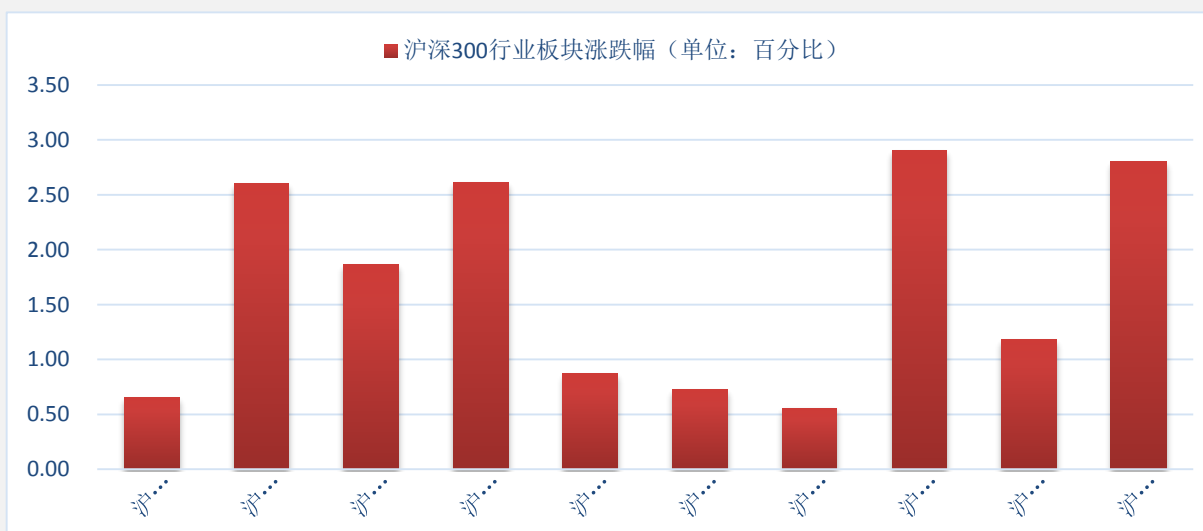
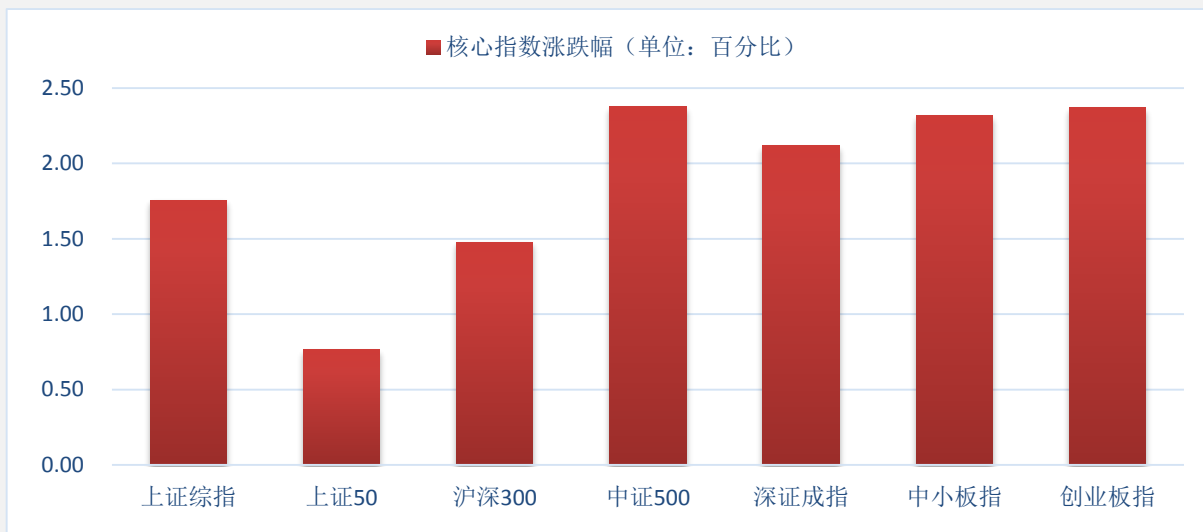
基差监测：



近3个月基差监测：

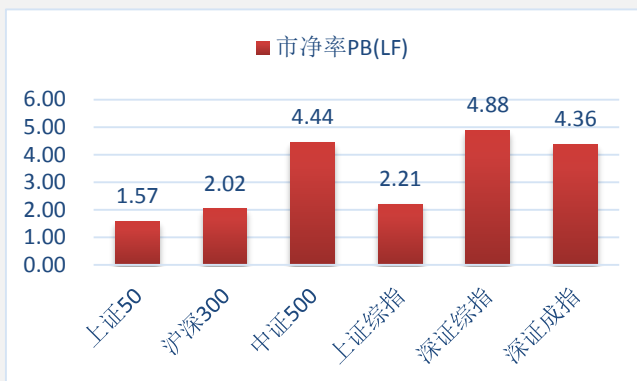
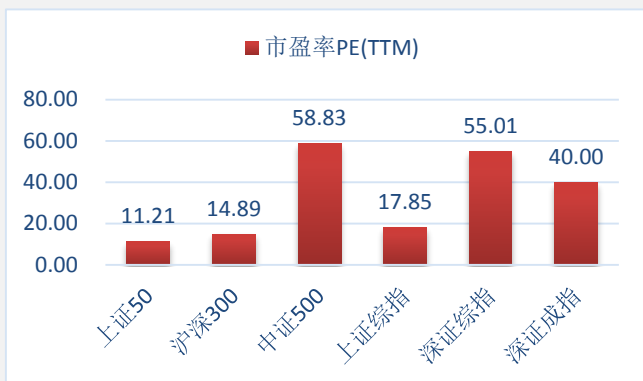


板块涨跌情况：

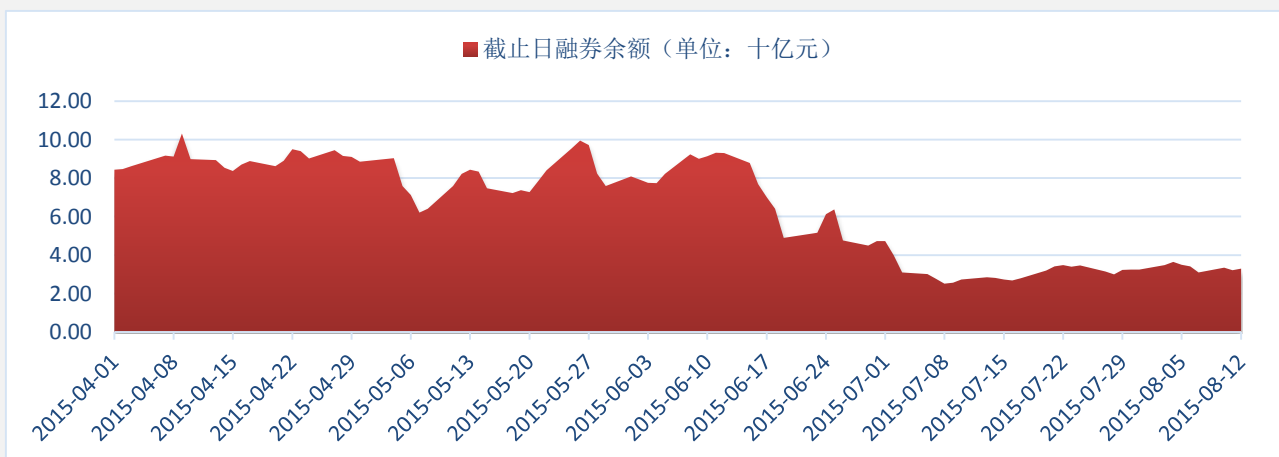
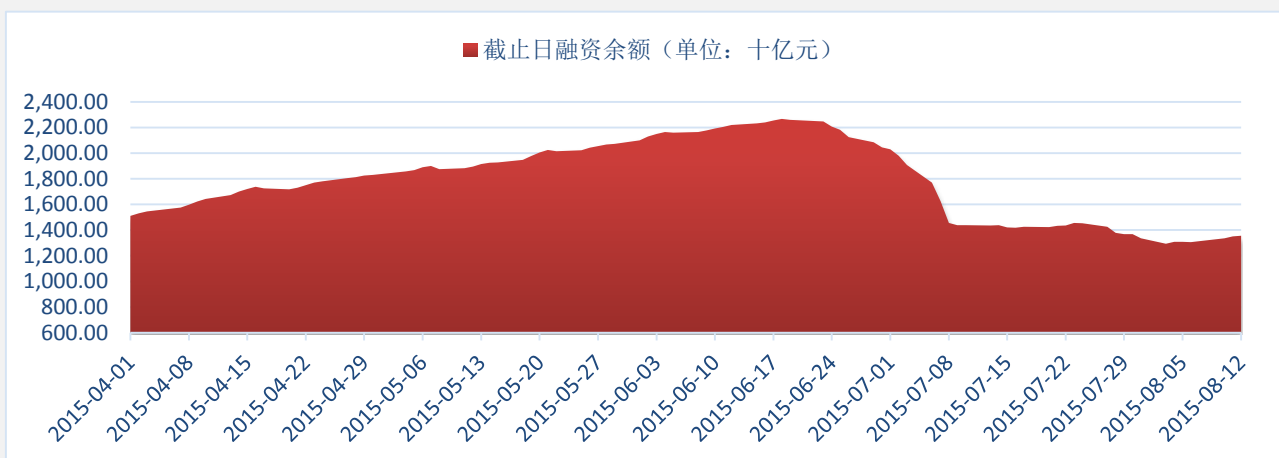


市场市盈率：

名称	上证 50	沪深 300	中证 500	上证综指	深证综指	深证成指
市盈率 PE	10.91	14.26	55.71	16.98	52.58	38.21
市净率 PB	1.53	1.95	4.17	2.10	4.65	4.20

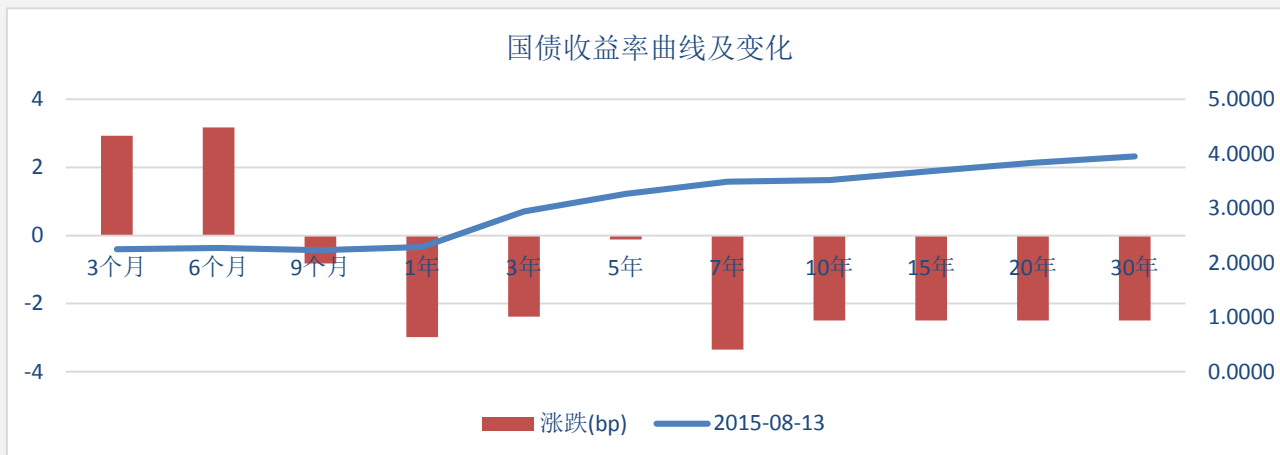


融资融券情况：

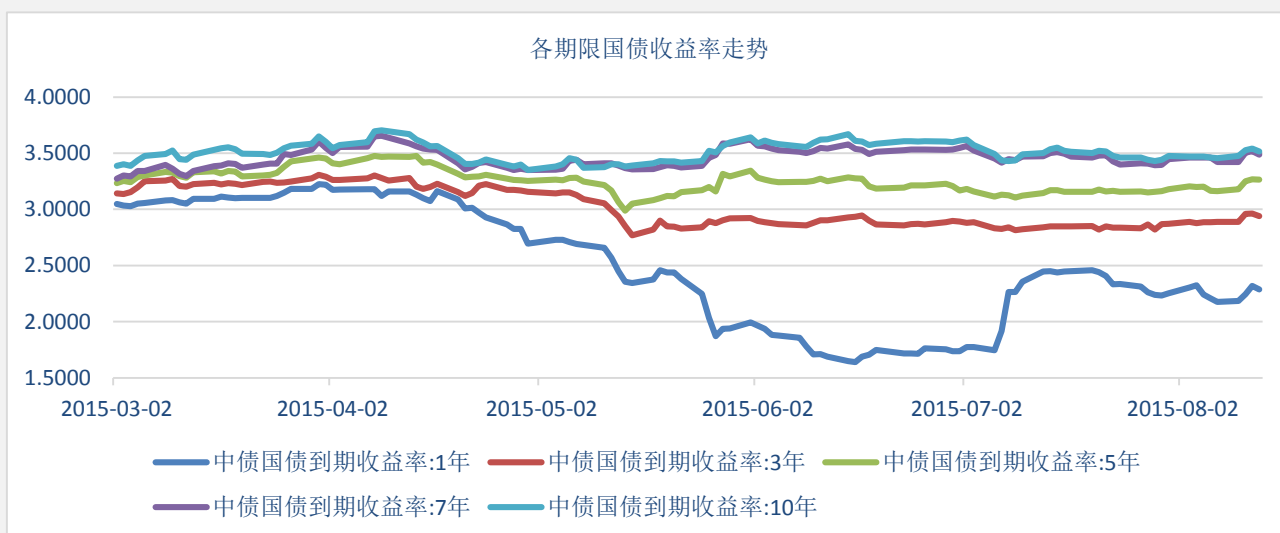


国债期货关键数据跟踪

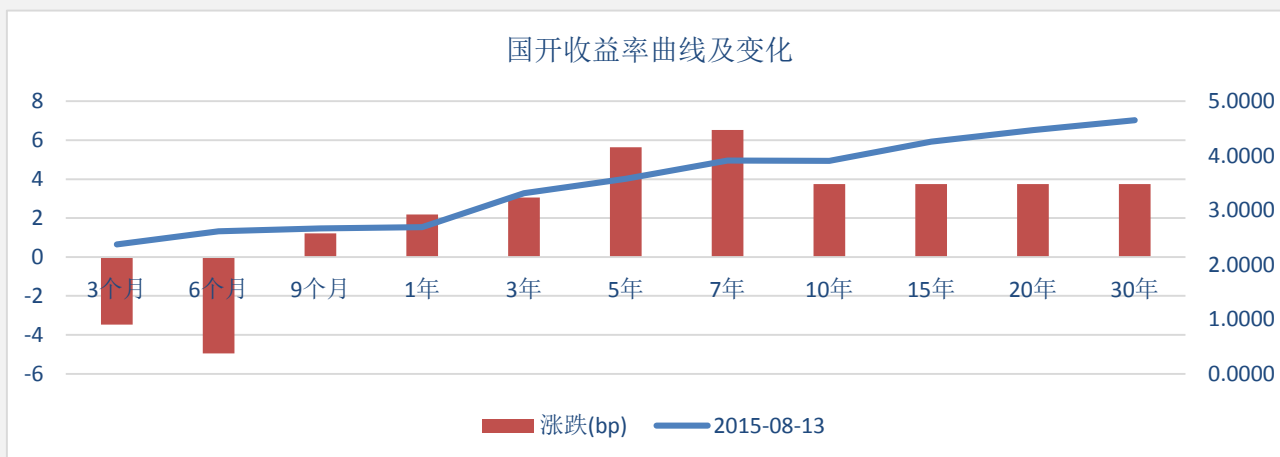
国债收益率曲线及变化情况:



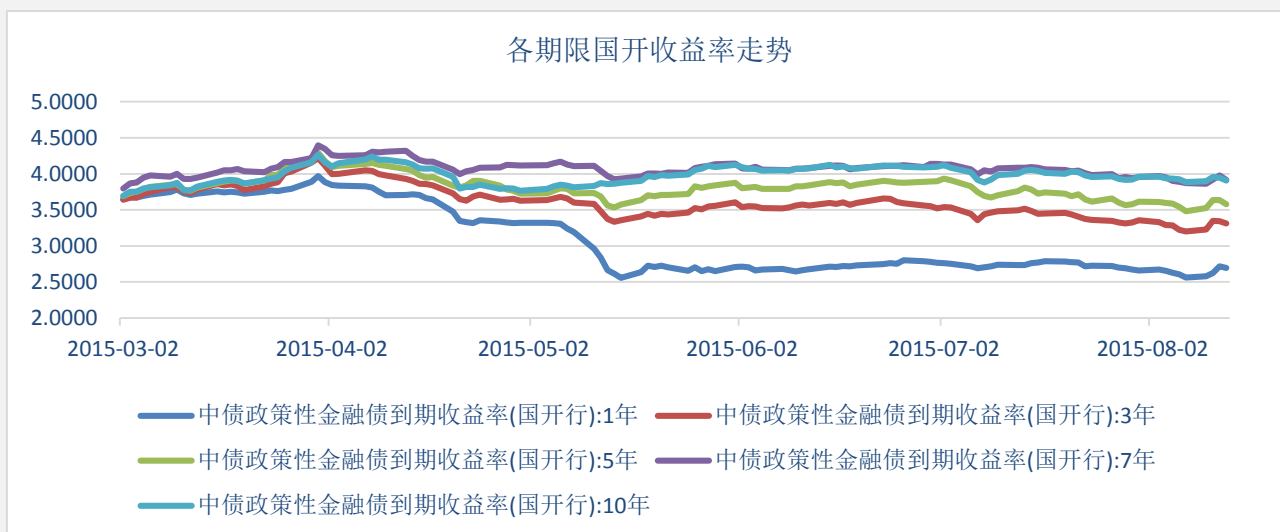
各期限国债收益率走势:



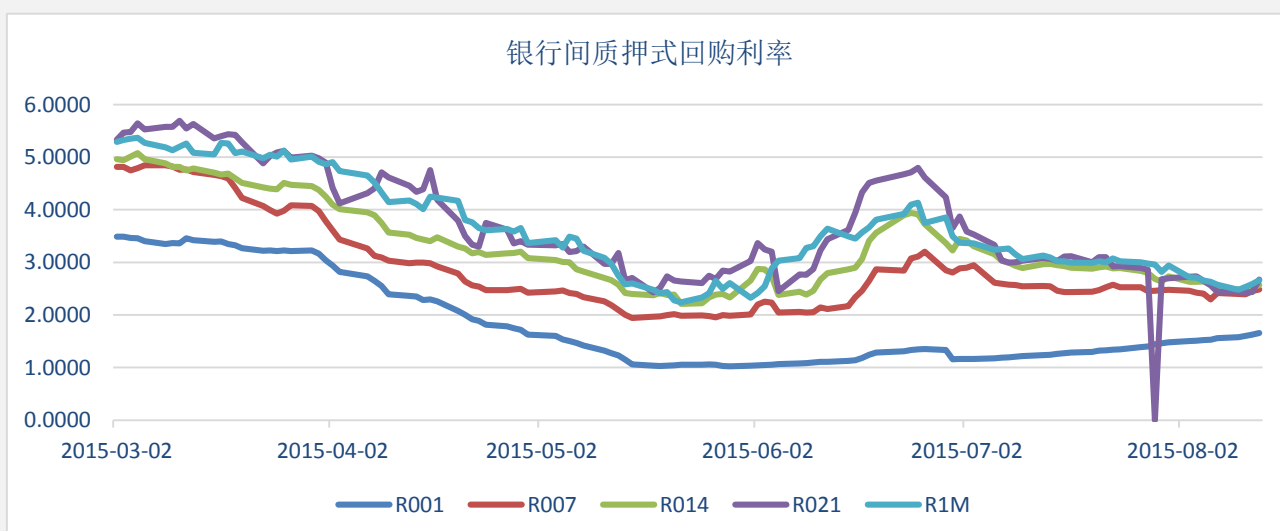
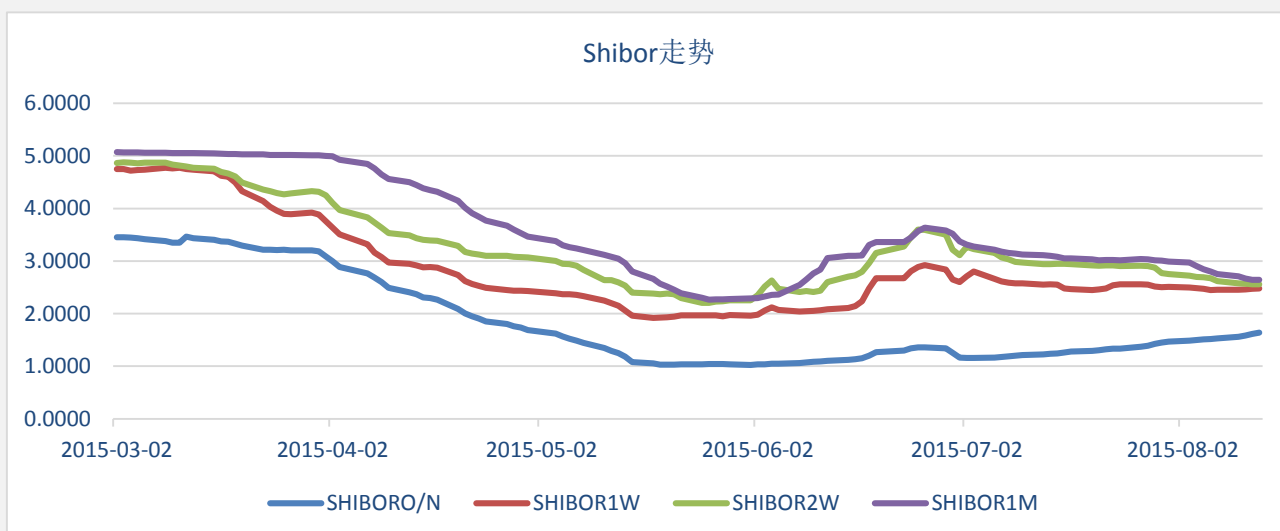
国开收益率曲线及变化情况:



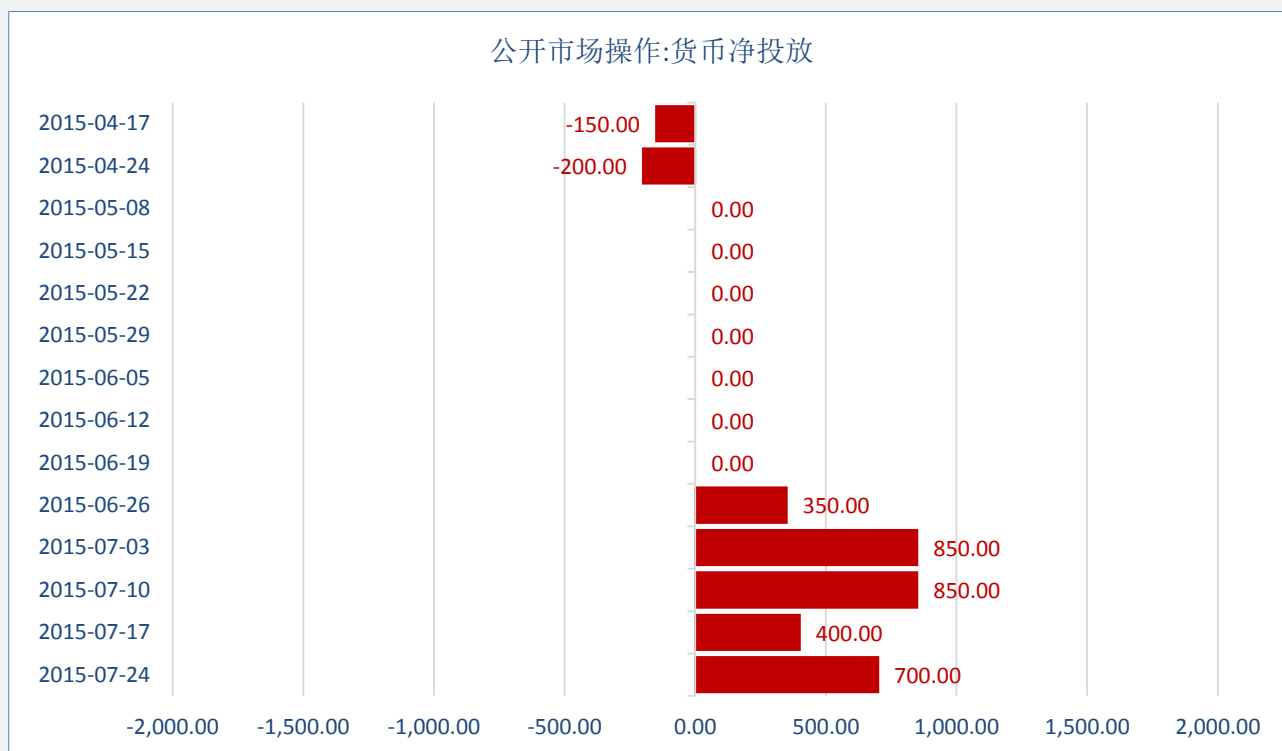
各期限国开利率走势:



银行间利率走势:



公开市场操作情况：



免责声明：

如果您对本报告有任何意见或建议，请致信于国都信箱 (yfb@guodu.cc)，欢迎您及时告诉我们您对本刊的任何想法！

本刊所有信息均建立在可靠的资料来源基础上。我们力求能为您提供精确的数据，客观的分析和全面的观点。但我们必须声明，对所有信息可能导致的任何损失概不负责。

本报告并不提供量身定制的投资建议。报告的撰写并未虑及读者的具体财务状况及目标。国都期货研究团队建议投资者应独立评估特定的投资和战略，并鼓励投资者征求专业财务顾问的意见。具体的投资或战略是否恰当取决于投资者自身的状况和目标。

版权声明：(c) 本报告版权为国都期货有限公司所有。本刊所含文字、数据和图表未经国都期货有限公司书面许可，任何人不得以电子、机械、影印、录音或其他任何形式复制、传播或存储于任何检索系统。未经许可，复制本刊任何内容皆属违反版权法行为，可能将受到法律起诉，并承担与之相关的所有损失赔偿和法律费用。涉及版权的所有问题请垂询：010-64000083。