

定期报告

股指期货日报

2015年9月17日星期四

---上证综指尾盘跳水，关注联储议息会议

行情综述

上证综指开盘延续了前一交易日良好上升走势，早盘震荡走高，午后一度逼近 3200 区域，但随后在 2:30 后开始大幅跳水，截止收盘从高点回落近 120 点。虽然配资清理放缓，结构化配资变更端口后可存续，但市场短期难以出现趋势性行情，上方压力位 3200 几次试探未果，而下方 3000 点也显示较强支撑，维持大盘围绕 3000 点震荡观点，且在当前估值下下行风险相对可控。

三大股指期货继续明显缩量，IF 主力合约日内成交仅 11370 手，而 IH 和 IC 主力合约日内成交不足 5000 手，且股指期货在 3 点股市收盘后成交更是清淡，日内走势基本趋同现货，由于本周五为股指期货交割日，当月合约并没有出现明显的贴水。

昨日市场消息较为密集，配资清理放缓有助于缓解市场短期恐慌情绪，而且卖压减小有助于市场企稳；此外，对于行业的整顿有助于提振市场信心。联储即将召开议息会议，我们认为其对 A 股市场影响相对有限，即便联储宣布加息，由于市场早有预期，预期实现对于市场整体利多。期指操作上仍然建议逢低多 IF 或 IH，但注意流动性枯竭下的滑点损失。



国都期货研发中心

廖鹏程

电话：010-84180311

邮件：

liaopengcheng@guodu.cc

执业证书编号：F0306044

市场要闻

1、外管局：8月，银行结汇 13044 亿元人民币，售汇 15789 亿元人民币，结售汇逆差 2745 亿元人民币；8月，银行代客结汇 7048 亿元人民币，售汇 15119 亿元人民币，结售汇逆差 8070 亿元人民币；1-8月，银行累计结汇 74795 亿元人民币，累计售汇 86670 亿元人民币，累计结售汇逆差 11874 亿元人民币；1-8月，银行代客累计结汇 66309 亿元人民币，累计售汇 81140 亿元人民币，累计结售汇逆差 14831 亿元人民币。

行情回顾

	开盘价	最高价	最低价	收盘价	成交量	持仓量	涨跌幅
IF1509	3304.6	3347.0	3228.4	3240.6	11370.0	9471.0	-0.68%
IF1510	3193.6	3228.4	3095.2	3118.0	13197.0	18622.0	-0.78%
IF1512	3021.8	3057.6	2922.6	2936.0	2393.0	12350.0	-0.90%
IF1603	2968.8	2990.8	2855.2	2863.0	188.0	1279.0	-1.41%
IH1509	2233.4	2255.4	2192.2	2195.2	4292.0	4746.0	-0.99%
IH1510	2185.4	2212.8	2144.0	2155.0	4407.0	8186.0	-0.59%
IH1512	2111.6	2128.6	2065.6	2071.6	841.0	4483.0	-0.79%
IH1603	2056.0	2087.0	2025.2	2044.2	67.0	470.0	-0.56%
IC1509	6100.0	6218.2	5855.0	5955.0	4130.0	3636.0	-1.17%
IC1510	5858.8	5998.0	5650.0	5699.0	7501.0	6170.0	-0.78%
IC1512	5457.6	5614.0	5216.2	5273.0	1122.0	2800.0	-2.15%
IC1603	5399.8	5440.0	5101.0	5152.8	152.0	736.0	-2.89%

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。