

定期报告

股指期货日报

2015年9月16日星期三

---配资清理放缓，大盘尾盘拉升

行情综述

上证综指早盘延续了前一交易日的低迷走势，整体围绕3000点震荡，午后跌破3000整数关口后开始急速拉升，截止收盘大盘上涨147.09点，收盘涨幅4.89%，技术上收于短期均线之上。虽然市场整体收涨，但是市场成交量较前一交易日并没有明显提升，这一上涨更加符合超跌后的反弹。

三大股指期货合约也纷纷收涨，走势基本与现货指数相一致，但是波动更为剧烈，沪深300股指期货远月合约涨幅超过7%，而中证500除当月合约涨幅6.76%外，其余三合约尾盘涨停。由于本周为股指期货合约到期交割日，当月合约的贴水基本修复，但是各合约下月合约仍然呈现出大幅贴水，体现了市场远期仍然较为悲观。

根据最新消息，北京地区多名信托公司和基金子公司人士证实，券商对于账户背后涉嫌存在配资行为的单一结构化信托或资管计划，不再采取“一刀切”的清理方式；由于配资清理放缓确认：结构化配资变更端口后可存续。这部分账户短期平仓压力的减缓有助于市场卖压减小，市场跌势短期放缓。此外，大盘3000点作为前期反复试探的点位，具有一定的支撑作用，在这一点位之下建议布局长线IF和IH多单。



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、配资清理放缓确认：结构化配资变更端口后可存续。北京地区多名信托公司和基金子公司人士证实，券商对于账户背后涉嫌存在配资行为的单一结构化信托或资管计划，不再采取“一刀切”的清理方式；
- 2、中国商务部：中国 8 月对外直接投资同比增长 7%，至 135 亿美元；中国 1-8 月对外直接投资同比增长 18.2%，至 770 亿美元；
- 3、发改委：取消企业发行外债的额度审批。国家发改委网站公布《关于推进企业发行外债备案登记制管理改革的通知》，其中提到：取消企业发行外债的额度审批，实行备案登记制管理。扩大企业外债规模，支持重点领域和产业转型升级。鼓励资信状况好、偿债能力强的企业发行外债。

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	3161.8	3346.0	3110.8	3304.8	17246.0	15837.0	5.60%
IF1510	2990.8	3230.0	2971.0	3193.6	9074.0	14026.0	7.62%
IF1512	2820.0	3050.0	2788.0	3001.8	2892.0	12285.0	7.28%
IF1603	2757.6	3008.0	2745.8	2951.6	285.0	1284.0	7.25%
IH1509	2168.0	2269.8	2133.2	2243.6	7009.0	7304.0	4.52%
IH1510	2102.2	2228.8	2076.6	2200.4	3521.0	6579.0	5.68%
IH1512	2002.2	2147.8	1985.0	2111.6	882.0	4402.0	6.40%
IH1603	1987.0	2108.0	1943.0	2073.2	91.0	461.0	5.89%
IC1509	5710.4	6200.0	5620.0	6050.8	7708.0	5599.0	6.76%
IC1510	5361.0	5804.6	5341.6	5804.6	5033.0	4528.0	10.00%
IC1512	5052.4	5457.6	5011.2	5457.6	1149.0	2750.0	10.00%
IC1603	4856.8	5333.8	4856.8	5333.8	172.0	703.0	10.00%

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。