

2015年9月7日星期一 研究所金融期货部



期指交易大幅萎缩，后市抛压依旧沉重

一、行情回顾

今日期指大幅上涨。IH 主力合约上涨 0.05%，收于 2052.4；IF 主力合约上涨 2.96%，收于 3096.2；IC 主力合约上涨 6.58%，收于 5795。



二、新闻聚焦

9月4日至5日，二十国集团（G20）财长和央行行长会议在土耳其首都安卡拉举行。中国人民银行行长周小川在会议上表示，目前人民币兑美元汇率已经趋于稳定，股市调整已大致到位，金融市场可望更为稳定。



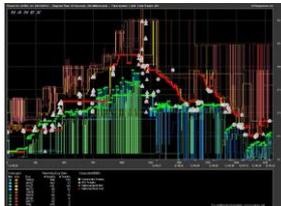
三、盘面分析

今日期指早盘大幅高开。受到中金所限制交易的影响，期指空头大幅平仓。不过午后银行股跳水，带动指数下行。从盘面看，股指期货交易量大幅萎缩，使得套保资金无法对冲风险，现货市场后期依旧抛压沉重。操作上，建议投资者暂时离场观望，等待做空机会。



四、当前策略

IH1509：离场观望
IF1509：离场观望
IC1509：离场观望



恒泰期货研究所金融期货部

恒泰期货研究所金融期货部主要从事股指期货、国债期货对冲组合策略产品的研究与开发，以及程序化交易策略产品的设计与开发。为基金公司、券商自营、资产管理以及投资公司提供系统性的对冲产品解决方案，从产品设计，程序化交易，风险管理等提供全方位的咨询与服务。

地址：上海市浦东新区峨山路91弄120号陆家嘴软件园8号楼201

邮编：200127

电话：(021) 60212736

网址：www.cnhtqh.com.cn

免责声明：本报告仅代表作者本人观点，不构成买卖之依据。报告用以提供给商业客户和职业投资者参考，未经允许不得转给他人，或者作为别的商业用途。尽管我们相信报告中数据和资料的来源是可靠的，但我们不保证它们绝对正确。我们也不承担因根据本报告操作而导致的损失。期货有风险，入市须谨慎。

