

 金融期货晨报

期 期 : 2016 年 8 月 16 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：昨日股票市场继续全面上涨，非银、地产板块表现强劲，沪指突破 3100 点。外盘持续上涨，美股三大股指齐创历史新高。基本面平稳，市场资金较充裕，在低利率的背景下，市场努力寻找各类高收益产品，加之外围股票市场表现强劲，市场信心得以缓慢恢复。国家队继续重仓并增持大盘蓝筹股的迹象十分明显，大量资金寻求相对高收益资产，激活大盘蓝筹股，抬高大盘的价值中枢，促使股指不断上行具有推动作用。建议多单操作。

国债期货：受上周末经济及金融数据影响，期债大幅高开并放量上行，但 10 点之后出现回落，银行间 10 年期国债收益率最低达到 2.61%，之后反弹至 2.64%，市场谨慎情绪增加，前期获利盘出货加大。虽然市场仍维持利率保持较低水平的预期，但利率下方空间愈发有限，交易盘的大量存在使得短期资金流入存在不确定性。在周末较大利好的刺激下，期债冲高回落，且价格长期未进行过调整，短期风险加大。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	2.0233	2.3411	2.7056	2.8028	2.9000	3.0278
Tibor	-	0.0136	0.0000	0.0600	0.1091	0.1309
Libor 美元	0.4191	0.4427	0.5067	0.8183	1.2067	1.5257
Libor 英镑	0.2294	0.2469	0.2794	0.3888	0.5046	0.7210
Libor 欧元	-0.3993	-0.3871	-0.3707	-0.3193	-0.2013	-0.0726

全球汇率

	2016-8-15	2016-8-12	2016-8-11	2016-8-10	2016-8-9	2016-8-8
欧元中间价	7.4147	7.4044	7.4196	7.4033	7.3837	7.3816
日元中间价	6.5571	6.526	6.5513	6.5352	6.5057	6.5217
美元中间价	6.643	6.6543	6.6255	6.653	6.6594	6.6615
美元指数	95.6205	95.7057	95.9312	95.5912	96.1306	96.3728
欧元兑美元	1.1184	1.1162	1.1135	1.1182	1.1114	1.1084
美元兑人民币即期	6.6406	6.6446	6.6415	6.643	6.6619	6.6624

各国股市概览

	收盘价	涨跌幅%		收盘价	涨跌幅%
道指	18636.05	0.321	FTSE100	6941.19	0.364
标普 500	2190.15	0.279	日经 225	16869.56	-0.298
德国 DAX	10739.21	0.241	上证综指	3125.20	2.443
法国 CAC	4497.86	-0.052	深证成指	10822.11	2.793

国内金融期货前日涨跌

	收盘价	涨跌幅%	持仓量	成交量
IF1608	3380	3.14	22158	15851
IF1609	3362.8	3.41	21169	8594
TF1612	101.83	0.11	19164	9647
T1612	101.71	0.15	32032	24714

中债国债到期收益率

	1Y	3Y	5Y	7Y	10Y	15Y
2016-8-15	2.1302	2.3555	2.4656	2.6316	2.6401	2.9807
2016-8-12	2.1385	2.3699	2.4752	2.6660	2.6701	3.0037
2016-8-11	2.1531	2.3843	2.4872	2.6811	2.6875	3.0335
2016-8-10	2.169	2.3712	2.5003	2.6821	2.6950	3.0383

市场资金加权平均利率

	R001. IB	R007. IB	GC001	GC007	IB0001	IB0007
2016-8-15	2.0519	2.4923	2.6674	2.4927	2.0838	2.4407
2016-8-12	2.0495	2.4640	2.5450	2.4734	2.094	2.501
2016-8-11	2.0669	2.5813	3.5128	2.5076	2.0773	2.5776
2016-8-10	2.0666	2.5327	2.4585	2.4695	2.0754	2.4437

活跃 CTD 券情况

		收盘价	成交量 (亿元)	修正久期 (年)	剩余期限 (年)	到期收益率 (%)
2016-8-15	160010.IB	102.39	111.90	8.28	9.73	2.6200
	160014.IB	102.10	10.20	6.11	6.84	2.6100
	160210.IB	101.23	753.10	8.13	9.64	3.0300
2016-8-12	160010.IB	101.96	77.70	8.28	9.73	2.6700
	160014.IB	101.66	17.80	6.11	6.85	2.6800
	160210.IB	100.92	310.80	8.13	9.65	3.0675

融资余额

	融资余额	沪市:融资余额	深市:融资余额
2016-8-12	8655.78	4864.85	3857.39
2016-8-11	8680.40	4798.39	3873.29
2016-8-10	8675.40	4807.76	3868.90
2016-8-9	8640.20	4807.19	3850.34
2016-8-8	8610.30	4790.47	3832.81
2016-8-5	8579.00	4778.20	3812.75
2016-8-4	8609.00	4766.93	3833.26

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	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 1505 室	电话：0579-82983171	邮编：321001
丽水营业部地址	浙江省丽水市莲都区金贸国际大厦 1502 室	电话：0578-2780000	邮编：323000
北京分公司地址	北京市海淀区车公庄西路乙 19 号 6 层 621 室	电话：010-88019159	邮编：100048