

 金融期货晨报

期 日 期 : 2016 年 8 月 17 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：昨日股票市场震荡回落，前期领涨板块出现回调。欧美主要市场均有所回落。昨日盘后，深港通方案获批消息放出，虽然短期实质性影响有限，但对市场信心有提振作用。资产荒仍是推动股票市场短期上涨的重要原因，昨日债券市场出现大幅回调，股票市场仍吸引更多资金进入。建议短多操作。

国债期货：期债冲高回落，周一央行进行 MLF 投放，周二上午一级市场国债招标需求保持旺盛，10 年期招标收益率 2.99%，但二级市场表现清淡，市场情绪降温，午后涌现大量抛盘，10 年期国债收益率大幅回升至 2.67%。期债成交量明显回落。市场对债券后市分歧增加，收益率连续 2 月大幅回落需要调整。昨夜美联储官员发表鹰派讲话，核心 CPI 同比增速连续第 9 个月高于美联储略低于 2% 的通胀目标，美债各期收益率均有不同程度上涨。建议日内做空

金融期货主要数据一览

全球利率

	0/N	1W	1M	3M	6M	12M
Shibor	2.0220	2.3430	2.7020	2.7995	2.8980	3.0260
Tibor	-	0.0136	0.0000	0.0600	0.1091	0.1309
Libor 美元	0.4189	0.4408	0.5074	0.8041	1.1974	1.5066
Libor 英镑	0.2294	0.2419	0.2731	0.3856	0.5065	0.7223
Libor 欧元	-0.4000	-0.3871	-0.3714	-0.3214	-0.2021	-0.0727

全球汇率

	2016-8-16	2016-8-15	2016-8-12	2016-8-11	2016-8-10	2016-8-9
欧元中间价	7.4166	7.4147	7.4044	7.4196	7.4033	7.3837
日元中间价	6.5522	6.5571	6.526	6.5513	6.5352	6.5057
美元中间价	6.6305	6.643	6.6543	6.6255	6.653	6.6594
美元指数	94.7949	95.6205	95.7057	95.9312	95.5912	96.1306
欧元兑美元	1.1274	1.1184	1.1162	1.1135	1.1182	1.1114
美元兑人民币即期	6.626	6.6406	6.6446	6.6415	6.643	6.6619

各国股市概览

	收盘价	涨跌幅%		收盘价	涨跌幅%
道指	18552.02	-0.451	FTSE100	6893.92	-0.681
标普 500	2178.15	-0.548	日经 225	16596.51	-1.619
德国 DAX	10676.65	-0.583	上证综指	3110.04	-0.485
法国 CAC	4460.44	-0.832	深证成指	10882.95	0.562

国内金融期货前日涨跌

	收盘价	涨跌幅%	持仓量	成交量
IF1608	3373.4	-0.63	16812	13177
IF1609	3351.4	-0.75	25640	8134
TF1612	101.715	-0.07	19779	8574
T1612	101.48	-0.18	32819	21304

中债国债到期收益率

	1Y	3Y	5Y	7Y	10Y	15Y
2016-8-16	2.0955	2.3566	2.4763	2.6609	2.6651	2.9916
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

市场资金加权平均利率

	R001. IB	R007. IB	GC001	GC007	IB0001	IB0007
2016-8-16	2.0460	2.4329	2.5346	2.5725	2.0795	2.4805
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

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 (%)
2016-8-16	160010.IB	101.95	163.00	8.27	9.72	2.6702
	160014.IB	101.78	21.20	6.11	6.84	2.6600
	160210.IB	100.21	463.89	8.11	9.64	3.1527
2016-8-17	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

融资余额

	融资余额	沪市:融资余额	深市:融资余额
2016-8-15	8764.70	4935.66	3900.61
2016-8-12	8655.10	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

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