

 **金融期货晨报**

期 期 : 2016 年 8 月 18 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：昨日股票市场窄幅震荡，前期领涨板块继续回调，金融、地产两大权重板块严重拖累股指表现。深港通未能带动市场情绪，能否带来实质性利好仍需等待，短期沪指涨幅过快，市场存在调整需要。固定资产投资增速继续放缓，近期债券市场出现明显谨慎情绪，资金持续流入股市寻找价值洼地的趋势仍将持续，建议多单操作。

国债期货：期债窄幅震荡，银行间市场情绪依旧偏弱，十年期国债收益率反弹触及 2.7%，一级市场招标收益率略高预期。消息面平淡，低利率对资金的吸引力逐步降低，前期获利盘存在了结动力，股票市场持续反弹也转移资金注意力。昨晚美联储发布 7 月纪要，加息分歧较大。虽然国内仍有降准呼声，但央行态度已然明确，目前对中国经济的担忧情绪较充分释放，中美利差是制约利率的重要因素，国债收益率下行难度大幅增加，长时间的单边上涨也需要调整。建议日内空单操作

金融期货主要数据一览

全球利率

	0/N	1W	1M	3M	6M	12M
Shibor	2.0220	2.3450	2.6980	2.7960	2.8970	3.0260
Tibor	-	0.0136	0.0000	0.0600	0.1091	0.1309
Libor 美元	0.4178	0.4413	0.5074	0.8013	1.1946	1.4982
Libor 英镑	0.2294	0.2419	0.2769	0.3844	0.5059	0.7223
Libor 欧元	-0.4000	-0.3871	-0.3714	-0.3216	-0.2021	-0.0727

全球汇率

	2016-8-17	2016-8-16	2016-8-15	2016-8-12	2016-8-11	2016-8-10
欧元中间价	7.4541	7.4166	7.4147	7.4044	7.4196	7.4033
日元中间价	6.58	6.5522	6.5571	6.526	6.5513	6.5352
美元中间价	6.6056	6.6305	6.643	6.6543	6.6255	6.653
美元指数	94.7246	94.7949	95.6205	95.7057	95.9312	95.5912
欧元兑美元	1.1288	1.1274	1.1184	1.1162	1.1135	1.1182
美元兑人民币即期	6.631	6.626	6.6406	6.6446	6.6415	6.643

各国股市概览

	收盘价	涨跌幅%		收盘价	涨跌幅%
道指	18573.94	0.118	FTSE100	6859.15	-0.504
标普 500	2182.22	0.187	日经 225	16745.64	0.899
德国 DAX	10537.67	-1.302	上证综指	3109.56	-0.015
法国 CAC	4417.68	-0.959	深证成指	10890.69	0.071

国内金融期货前日涨跌

	收盘价	涨跌幅%	持仓量	成交量
IF1608	3365.8	-0.40	10954	11012
IF1609	3341.8	-0.52	31048	9245
TF1612	101.695	-0.05	20428	7786
T1612	101.41	-0.11	33278	17553

中债国债到期收益率

	1Y	3Y	5Y	7Y	10Y	15Y
2016-8-17	2.1004	2.3569	2.4974	2.6859	2.6901	3.0166
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

市场资金加权平均利率

	R001. IB	R007. IB	GC001	GC007	IB0001	IB0007
2016-8-17	2.0488	2.4607	2.6498	2.5366	2.0779	2.4567
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

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 (%)
2016-8-17	160010.IB	101.83	132.80	8.27	9.72	2.6850
	160014.IB	101.78	0.00	6.10	6.83	2.6600
	160210.IB	100.83	398.30	8.12	9.64	3.0775
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

融资余额

	融资余额	沪市:融资余额	深市:融资余额
2016-8-16	8865.09	4956.59	3929.43
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

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