



金融期货晨报

日期：2016年8月22日

期谚日日谈

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：上周股票市场冲高回落，周一大幅拉升后出现持续回调，周成交量放大。前期领涨板块继续回调，房地产、券商、银行等权重品种在后半周拖累股指跳水，沪指最终守住 3100 点关口。权重股展开分化，题材股小幅活跃，市场努力寻找更多题材。深港通渐行渐近，G20 峰会即将召开，在经济压力仍然较大时期，市场期待更多政策的落实，短期沪指在年线附近保持震荡。建议观望。

国债期货：上周国债期货高开回落，10 年期国债收益率周一最低下降至 2.61%，随后几日持续上涨，周五回升至 2.71%。“资产荒”是此轮债券收益率大幅回落的重要因素，随着债券收益率快速走低，债券对配置盘的吸引力不断降低，一级市场国债投标倍数出现回落。占市场主要力量的配置盘出现谨慎后，交易盘在已获得较高价差收益的情况下选择获利了结，导致债券收益率回升，进而促使配置盘更加谨慎。相对于前期的上涨行情，期债下方空间不大，投资者应密切关注市场情绪，建议日内空单操作，关注一级市场招标情况及二级市场抛盘压力。

金融期货主要数据一览

全球利率

	0/N	1W	1M	3M	6M	12M
Shibor	2.0230	2.3470	2.6960	2.7930	2.8960	3.0270
Tibor	-	0.0136	0.0000	0.0600	0.1091	0.1309
Libor 美元	0.4172	0.4411	0.5124	0.8110	1.2101	1.5154
Libor 英镑	0.2294	0.2422	0.2766	0.3878	0.5131	0.7338
Libor 欧元	-0.4007	-0.3871	-0.3714	-0.3203	-0.2023	-0.0734

全球汇率

	2016-8-19	2016-8-18	2016-8-17	2016-8-16	2016-8-15	2016-8-12
欧元中间价	7.5121	7.4829	7.4541	7.4166	7.4147	7.4044
日元中间价	6.6094	6.6401	6.58	6.5522	6.5571	6.526
美元中间价	6.6211	6.6273	6.6056	6.6305	6.643	6.6543
美元指数	94.4965	94.1869	94.7246	94.7949	95.6205	95.7057
欧元兑美元	1.1325	1.1349	1.1288	1.1274	1.1184	1.1162
美元兑人民币即期	6.65	6.6322	6.631	6.626	6.6406	6.6446

各国股市概览

	收盘价	涨跌幅%		收盘价	涨跌幅%
道指	18552.57	-0.243	FTSE100	6858.95	-0.146
标普 500	2183.87	-0.144	日经 225	16545.82	0.363
德国 DAX	10544.36	-0.553	上证综指	3108.10	0.128
法国 CAC	4400.52	-0.824	深证成指	10872.71	-0.060

国内金融期货前日涨跌

	收盘价	涨跌幅%	持仓量	成交量
IF1608	3359.8	-0.01	0	4746
IF1609	3332.4	0.01	39407	12783
TF1612	101.545	-0.15	19174	11049
T1612	101.185	-0.25	33124	24507

中债国债到期收益率

	1Y	3Y	5Y	7Y	10Y	15Y
2016-8-19	2.1015	2.3679	2.5264	2.7152	2.7001	3.0456
2016-8-18	2.0904	2.3473	2.5059	2.6900	2.6801	3.0166
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

市场资金加权平均利率

	R001. IB	R007. IB	GC001	GC007	IB0001	IB0007
2016-8-19	2.0489	2.4704	2.8510	2.5385	2.0713	2.4675
2016-8-18	2.0541	2.5000	5.3595	2.4689	2.0834	2.4765
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

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 (%)
2016-8-19	160010.IB	101.52	153.96	8.26	9.72	2.7206
	160014.IB	101.44	29.60	6.09	6.83	2.7150
	160210.IB	100.60	304.24	8.11	9.63	3.1050
2016-8-18	160010.IB	101.70	99.80	8.26	9.72	2.7000
	160014.IB	101.63	21.10	6.10	6.83	2.6850
	160210.IB	101.39	329.30	8.12	9.64	3.0107

融资余额

	融资余额	沪市:融资余额	深市:融资余额
2016-8-18	8941.50	4982.82	3956.80
2016-8-17	8897.50	4985.44	3941.69
2016-8-16	8864.20	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

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