

 **金融期货晨报**

期 期：2016年8月23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：**股票市场继续回落，沪指失守 3100 点，军工、有色板块跌幅靠前，市场成交逐步回落，前期强势热点退潮。市场观望情绪逐渐抬头，多空分歧也逐渐有所加大，防御性板块表现更强。在经济压力仍然较大时期，市场期待更多政策的落实，做多信心在减退，资金有主动撤离的迹象，短期沪指在年线附近保持震荡。建议观望。

**国债期货：**期债低开高走，银行间债券收益率重新回落，午后债券买盘涌现。在基本面及政策面平静时，市场仍保持看涨，持续一个星期的回调之后，利率债止盈盘逐步减少，主动买盘出现。建议日内多单操作。

# 金融期货主要数据一览

## 全球利率

	0/N	1W	1M	3M	6M	12M
Shibor	2.0233	2.3467	2.6978	2.7944	2.8967	3.0267
Tibor	-	0.0136	0.0000	0.0600	0.1091	0.1309
Libor 美元	0.4156	0.4427	0.5211	0.8171	1.2146	1.5232
Libor 英镑	0.2294	0.2422	0.2766	0.3875	0.5163	0.7343
Libor 欧元	-0.4013	-0.3871	-0.3714	-0.3203	-0.2023	-0.0727

## 全球汇率

	2016-8-22	2016-8-19	2016-8-18	2016-8-17	2016-8-16	2016-8-15
欧元中间价	7.5204	7.5121	7.4829	7.4541	7.4166	7.4147
日元中间价	6.6269	6.6094	6.6401	6.58	6.5522	6.5571
美元中间价	6.6652	6.6211	6.6273	6.6056	6.6305	6.643
美元指数	94.5381	94.4965	94.1869	94.7246	94.7949	95.6205
欧元兑美元	1.132	1.1325	1.1349	1.1288	1.1274	1.1184
美元兑人民币即期	6.6578	6.65	6.6322	6.631	6.626	6.6406

## 各国股市概览

	收盘价	涨跌幅%		收盘价	涨跌幅%
道指	18529.42	-0.125	FTSE100	6828.54	-0.443
标普 500	2182.64	-0.056	日经 225	16598.19	0.317
德国 DAX	10494.35	-0.474	上证综指	3084.81	-0.750
法国 CAC	4389.94	-0.240	深证成指	10731.40	-1.300

## 国内金融期货前日涨跌

	收盘价	涨跌幅%	持仓量	成交量
IF1609	3317	-0.51	39552	11748
IF1610	3289	0.00	214	214
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
2016-8-22	2.1032	2.3841	2.5079	2.6925	2.6801	3.0256
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

## 市场资金加权平均利率

	R001. IB	R007. IB	GC001	GC007	IB0001	IB0007
2016-8-22	0.0000	0.0000	2.6466	2.4962	2.0713	2.4675
2016-8-19	2.0489	2.4704	2.8510	2.5385	2.0834	2.4765
2016-8-18	2.0541	2.5000	5.3595	2.4689	2.0779	2.4567
2016-8-17	2.0488	2.4607	2.6498	2.5366	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 (%)
2016-8-22	160010.IB	101.48	143.42	8.25	9.71	2.7250
	160014.IB	101.56	226.40	6.09	6.82	2.6950
	160210.IB	100.56	439.60	8.10	9.62	3.1100
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

## 融资余额

	融资余额	沪市:融资余额	深市:融资余额
2016-8-19	8939.70	4991.45	3957.63
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

## 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