

金融期货晨报

日期：2016年8月24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：昨日沪指冲高回落，大盘最高上攻 3101 点附近，下午两市上涨势头趋缓，成交量进一步萎缩。市场观望情绪加重，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。市场整体处于降低金融杠杆的过程，政策引导资金重回实体经济，宽松性政策难以出现，大盘缺乏上行动力，维持震荡。建议观望。

国债期货：期债震荡回落，虽然上午 10 年期国开债招标收益率低于预期，但收益率小幅回落后银行间债券市场仍有较大抛压，10 年期国债收益率较周一日上升 3BP。消息面，央行 14 天期逆回购缩量，引发市场对央行锁短放长操作的猜测，意图降低债券杠杆。连续 2 日资金净回笼导致银行间市场资金明显偏紧，7 天质押回购利率上行至 3% 高位，并有传言少数机构出现违约，加大短期债券市场抛盘。近期国内各部委加强 PPP 推介力度，未来投资增速有望企稳。昨晚美国新屋销售靓丽美股收涨，美联储加息预期提升。建议日内偏空操作。

金融期货主要数据一览

全球利率

	0/N	1W	1M	3M	6M	12M
Shibor	2.0330	2.3520	2.6960	2.7930	2.8950	3.0260
Tibor	-	0.0136	0.0000	0.0600	0.1091	0.1309
Libor 美元	0.4167	0.4447	0.5222	0.8254	1.2290	1.5329
Libor 英镑	0.2294	0.2422	0.2741	0.3875	0.5188	0.7318
Libor 欧元	-0.4007	-0.3871	-0.3714	-0.3203	-0.2023	-0.0720

全球汇率

	2016-8-23	2016-8-22	2016-8-19	2016-8-18	2016-8-17	2016-8-16
欧元中间价	7.5379	7.5204	7.5121	7.4829	7.4541	7.4166
日元中间价	6.6404	6.6269	6.6094	6.6401	6.58	6.5522
美元中间价	6.6586	6.6652	6.6211	6.6273	6.6056	6.6305
美元指数	94.5258	94.5381	94.4965	94.1869	94.7246	94.7949
欧元兑美元	1.1306	1.132	1.1325	1.1349	1.1288	1.1274
美元兑人民币即期	6.6416	6.6578	6.65	6.6322	6.631	6.626

各国股市概览

	收盘价	涨跌幅%		收盘价	涨跌幅%
道指	18547.09	0.095	FTSE100	6868.51	0.585
标普 500	2186.9	0.195	日经 225	16497.36	-0.607
德国 DAX	10592.88	0.939	上证综指	3089.71	0.159
法国 CAC	4421.45	0.718	深证成指	10750.29	0.176

国内金融期货前日涨跌

	收盘价	涨跌幅%	持仓量	成交量
IF1609	3318	0.01	40244	12959
IF1610	3296.4	0.03	346	326
TF1612	101.4	-0.19	19436	10474
T1612	100.985	-0.35	34352	31432

中债国债到期收益率

	1Y	3Y	5Y	7Y	10Y	15Y
2016-8-23	2.1026	2.3949	2.5445	2.7498	2.7201	3.0683
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

市场资金加权平均利率

	R001. IB	R007. IB	GC001	GC007	IB0001	IB0007
2016-8-23	2.0997	2.6147	2.9575	2.6765	2.0751	2.5083
2016-8-22	2.0047	2.4675	2.6466	2.4962	2.0703	2.4193
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

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 (%)
2016-8-23	160010.IB	101.27	94.70	8.24	9.70	2.7500
	160014.IB	101.34	41.50	6.08	6.82	2.7300
	160210.IB	100.23	382.00	8.09	9.62	3.1500
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

融资余额

	融资余额	沪市:融资余额	深市:融资余额
2016-8-22	8955.60	4997.34	3964.87
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

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