



金融期货晨报

日期：2016年9月2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：昨日股票市场震荡回落，成交量略有增加。中国8月制造业PMI大幅回升至50.4，官方与财新数据继续分化。市场对经济的仍有担忧，基本面维持较大压力，市场仍处存量博弈，市场资金整体较为宽松。进入9月，沪指仍未攻下的3100点关口让市场处于谨慎。短期内估计股市仍将处于震荡期，加之新股陆续发行导致次新股板块持续承压，建议观望

国债期货：期债低开反弹，波动幅度增加，银行间资金利率略有回落，上午口行招标需求回暖，认购倍数明显提升，二级市场抛盘减少，午后国债收益率小幅回落。官方制造业PMI重上荣枯线，“小非农”增加，市场对美联储加息保持警惕。短期期债进入震荡，市场对经济数据及美联储加息的关注度提升。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	2.0660	2.3680	2.6960	2.7910	2.8895	3.0260
Tibor	-	0.0136	0.0000	0.0600	0.1091	0.1309
Libor 美元	0.4194	0.4436	0.5249	0.8393	1.2445	1.5571
Libor 英镑	0.2256	0.2441	0.2747	0.3875	0.5200	0.7378
Libor 欧元	-0.4041	-0.3871	-0.3736	-0.3226	-0.2049	-0.0753

全球汇率

	2016-9-1	2016-8-31	2016-8-30	2016-8-29	2016-8-26	2016-8-25
欧元中间价	7.456	7.4602	7.4749	7.483	7.5079	7.4986
日元中间价	6.4678	6.5035	6.5557	6.5575	6.6138	6.6272
美元中间价	6.6784	6.6908	6.6812	6.6856	6.6488	6.6602
美元指数	95.6454	95.9868	96.0527	95.5805	95.47	94.7254
欧元兑美元	1.1196	1.1158	1.1143	1.1186	1.1195	1.1283
美元兑人民币即期	6.68	6.6783	6.68	6.679	6.6688	6.6535

各国股市概览

	收盘价	涨跌幅%		收盘价	涨跌幅%
道指	18419.3	0.100	FTSE100	6745.97	-0.524
标普 500	2170.86	-0.004	日经 225	16926.84	0.234
德国 DAX	10534.31	-0.551	上证综指	3063.31	-0.719
法国 CAC	4439.67	0.033	深证成指	10669.51	-0.821

国内金融期货前日涨跌

	收盘价	涨跌幅%	持仓量	成交量
IF1609	3271.8	-1.02	37722	11261
IF1610	3250.4	-1.11	2394	644
TF1612	101.325	0.01	20937	7869
T1612	100.77	0.04	35599	25206

中债国债到期收益率

	1Y	3Y	5Y	7Y	10Y	15Y
2016-9-1	2.113	2.4137	2.5622	2.7858	2.7452	3.0942
2016-8-31	2.116	2.4275	2.5713	2.7895	2.7425	3.0912
2016-8-30	2.1286	2.4275	2.5663	2.8019	2.7527	3.1038
2016-8-29	2.1282	2.4120	2.5611	2.7619	2.7064	3.0618

市场资金加权平均利率

	R001. IB	R007. IB	GC001	GC007	IB0001	IB0007
2016-9-1	2.0960	2.3931	3.2283	2.3492	2.1118	2.4218
2016-8-31	2.0951	2.3949	2.3701	2.4566	2.1112	2.4624
2016-8-30	2.1059	2.4098	2.3809	2.5646	2.1046	2.5031
2016-8-29	2.1109	2.4368	2.5711	2.5829	2.0883	2.4724

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 (%)	
2016-9-1	160010.IB	100.92	52.70	8.21	9.68	2.7900
	160014.IB	101.00	29.50	6.05	6.79	2.7850
	160210.IB	99.83	244.40	8.06	9.60	3.2000
2016-8-31	160010.IB	101.01	108.40	8.21	9.68	2.7800
	160014.IB	100.97	87.25	6.05	6.79	2.7900
	160210.IB	99.91	382.90	8.06	9.60	3.1900

融资余额

	融资余额	沪市:融资余额	深市:融资余额
2016-8-31	8995.90	5015.36	3979.99
2016-8-30	8976.60	5017.16	3967.76
2016-8-29	8976.90	5010.05	3963.30
2016-8-26	8955.00	5014.77	3956.50
2016-8-25	8976.10	4999.38	3969.01
2016-8-24	8974.20	5007.92	3971.06
2016-8-23	8961.00	5004.01	3964.47

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