

 **金融期货晨报**

期 期 : 2016 年 9 月 14 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：昨日股票市场小幅反弹，成交量明显萎缩。虽然昨日欧美股市出现反弹，但目前市场对对货币政策转变及流动性拐点的担忧仍在加剧。国内央行锁短放长等降杠杆措施收紧股票市场资金流入，经济基本面仍有较大压力，市场缺乏热点，临近节日，持币观望心态加重。昨日欧美股市再次大跌，外围股市动荡可能持续影响国内市场心态，建议观望。

国债期货：昨日期债增量反弹，受欧美债券市场反弹影响，中国银行间国债收益率回落，二级市场买盘增多。虽然公布的经济数据显示出企稳迹象，但市场受全球债市氛围影响。短期多空因素交织，期债难以形成方向性趋势，市场情绪受消息面影响较大。昨日欧美股票、债市再次大幅回落，将对期债造成打压。建议空单操作。

金融期货主要数据一览

全球利率

	0/N	1W	1M	3M	6M	12M
Shibor	2.1080	2.3855	2.6792	2.7850	2.8789	3.0265
Tibor	-	0.0136	0.0000	0.0600	0.1091	0.1309
Libor 美元	0.4210	0.4453	0.5277	0.8558	1.2553	1.5664
Libor 英镑	0.2289	0.2431	0.2694	0.3796	0.5278	0.7483
Libor 欧元	-0.4007	-0.3871	-0.3729	-0.3201	-0.2061	-0.0769

全球汇率

	2016-9-13	2016-9-12	2016-9-9	2016-9-8	2016-9-7	2016-9-6
欧元中间价	7.5001	7.5161	7.5134	7.4894	7.4881	7.4383
日元中间价	6.5549	6.5321	6.5181	6.5485	6.5384	6.445
美元中间价	6.6726	6.6908	6.6684	6.662	6.6555	6.6676
美元指数	95.5621	95.1432	95.3598	95.01	94.963	94.8647
欧元兑美元	1.1215	1.1235	1.1225	1.1261	1.1239	1.125
美元兑人民币即期	6.68	6.6799	6.6799	6.6639	6.6641	6.6803

各国股市概览

	收盘价	涨跌幅%		收盘价	涨跌幅%
道指	18067.44	-1.406	FTSE100	6665.63	-0.526
标普 500	2127.02	-1.483	日经 225	16729.04	0.337
德国 DAX	10386.6	-0.433	上证综指	3023.51	0.051
法国 CAC	4387.18	-1.185	深证成指	10514.58	0.507

国内金融期货前日涨跌

	收盘价	涨跌幅%	持仓量	成交量
IF1609	3245.6	0.27	14220	12019
IF1610	3208.6	0.09	19860	7786
TF1612	101.405	0.12	20992	9303
T1612	100.92	0.27	36396	22740

中债国债到期收益率

	1Y	3Y	5Y	7Y	10Y	15Y
2016-9-13	2.1722	2.4467	2.5732	2.7750	2.7654	3.0875
2016-9-12	2.1854	2.4511	2.5782	2.7950	2.7916	3.1042
2016-9-9	2.1622	2.4249	2.5632	2.7725	2.7678	3.0897
2016-9-8	2.1405	2.4256	2.5739	2.7825	2.7753	3.1035

市场资金加权平均利率

	R001. IB	R007. IB	GC001	GC007	IB0001	IB0007
2016-9-13	2.1851	2.5376	8.1698	2.4142	2.1429	2.5
2016-9-12	2.1621	2.4133	2.5368	2.5633	2.1358	2.5431
2016-9-9	2.1230	2.3177	2.3710	2.9381	2.1281	2.529
2016-9-8	2.1200	2.3358	2.7612	3.3510	2.1393	2.4435

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 (%)
2016-9-13	160010.IB	100.93	49.50	8.18	9.65	2.7895
	160014.IB	101.06	16.90	6.02	6.76	2.7743
	160210.IB	100.11	228.30	8.03	9.56	3.1650
2016-9-2	160010.IB	100.80	62.30	8.18	9.65	2.8050
	160014.IB	100.90	18.00	6.02	6.76	2.8000
	160210.IB	100.12	246.66	8.03	9.57	3.1636

融资余额

	融资余额	沪市:融资余额	深市:融资余额
2016-9-12	8971.37	4996.35	3973.97
2016-9-9	9003.00	4997.40	3987.11
2016-9-8	9037.50	5017.01	4001.49
2016-9-7	9023.20	5037.09	3991.49
2016-9-6	9022.90	5032.74	3993.72
2016-9-5	8960.30	5030.14	3956.05
2016-9-2	8954.50	5005.17	3959.75

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