

 **金融期货晨报**

期 期 : 2016 年 9 月 19 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：上周股票市场大幅下挫，成交量持续萎缩，沪指险守 3000 点。市场对对货币政策转变及流动性拐点的担忧仍在加剧，中秋节前市场观望氛围浓厚。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。欧美股市弱势震荡，持续影响国内市场心态，市场对外部经济风险的担忧加剧，短期关注沪指 3000 点支撑位。建议观望。

国债期货：国债期货小幅反弹，市场情绪成为主导因素，市场对中国央行和美联储的政策态度更加关注。近期国外政策出现了加大财政刺激，货币政策宽松力度减弱的呼声，国内财政政策将进一步加码，对国债收益率产生支撑作用，考虑到基本面仍然偏弱，投资者应密切关注市场情绪，建议观望为主，关注国内政策面情况及国际货币政策的变化。

金融期货主要数据一览

全球利率

	0/N	1W	1M	3M	6M	12M
Shibor	2.1400	2.3940	2.6896	2.7919	2.8815	3.0275
Tibor	-	0.0127	0.0000	0.0600	0.1091	0.1309
Libor 美元	0.4204	0.4523	0.5318	0.8571	1.2473	1.5449
Libor 英镑	0.2288	0.2456	0.2694	0.3803	0.5272	0.7476
Libor 欧元	-0.4016	-0.3871	-0.3740	-0.3209	-0.2083	-0.0730

全球汇率

	2016-9-14	2016-9-13	2016-9-12	2016-9-9	2016-9-8	2016-9-7
欧元中间价	7.5059	7.5001	7.5161	7.5134	7.4894	7.4881
日元中间价	6.5279	6.5549	6.5321	6.5181	6.5485	6.5384
美元中间价	6.6895	6.6726	6.6908	6.6684	6.662	6.6555
美元指数	95.3221	95.5621	95.1432	95.3598	95.01	94.963
欧元兑美元	1.1248	1.1215	1.1235	1.1225	1.1261	1.1239
美元兑人民币即期	6.6711	6.68	6.6799	6.6799	6.6639	6.6641

各国股市概览

	收盘价	涨跌幅%		收盘价	涨跌幅%
道指	18123.8	-0.487	FTSE100	6710.28	-0.297
标普 500	2139.16	-0.377	日经 225	16519.29	0.697
德国 DAX	10276.17	-1.486	上证综指	3002.84	-0.68
法国 CAC	4332.45	-0.932	深证成指	10454.24	-0.57

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	101.435	0.03	21195	8620
T1612	100.975	0.07	36448	21223

中债国债到期收益率

	1Y	3Y	5Y	7Y	10Y	15Y
2016-9-18	2.1834	2.4480	2.5748	2.7612	2.7655	3.0850
2016-9-14	2.1717	2.4471	2.5708	2.7600	2.7579	3.0824
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

市场资金加权平均利率

	R001. IB	R007. IB	GC001	GC007	IB0001	IB0007
2016-9-18	2.2033	2.4336	0.0000	0.0000	2.1688	2.558
2016-9-14	2.1586	2.6182	3.6050	1.8589	2.1471	2.5703
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

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 (%)
2016-9-18	160010.IB	100.84	13.30	8.16	9.63	2.8000
	160014.IB	101.09	0.00	6.01	6.75	2.7697
	160210.IB	100.82	15.50	8.03	9.55	3.0777
2016-9-14	160010.IB	101.01	15.60	8.18	9.64	2.7800
	160014.IB	101.09	4.40	6.02	6.76	2.7697
	160210.IB	100.19	158.30	8.03	9.56	3.1550

融资余额

	融资余额	沪市:融资余额	深市:融资余额
2016-9-13	8959.30	4962.29	3963.91
2016-9-12	8970.40	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

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