

 **金融期货晨报**

期 期：2016年9月21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：昨日股票市场小幅回落，成交量继续萎缩，全天振幅仅0.4%，市场人气极度低迷。在中秋、国庆之间，市场自身内生动力不足、存量资金逐步流失，外部存在不确定因素，抑制了市场热情。议息会议、美国大选、国内监管趋严、货币政策拐点、地产调控的边际拐点等，均是市场关注风险点，但引发系统性风险甚至创新低的概率不大，整体仍维持区间震荡。建议观望。

国债期货：昨日期债冲高回落，银行间市场国债收益率小幅下行，期债成交量保持低位，市场仍偏谨慎。美联储议息会议即将召开，对市场将产生较大影响。建议观望。

金融期货主要数据一览

全球利率

	0/N	1W	1M	3M	6M	12M
Shibor	2.1590	2.4000	2.6990	2.7990	2.8823	3.0275
Tibor	-	0.0127	0.0000	0.0600	0.1091	0.1309
Libor 美元	0.4216	0.4548	0.5362	0.8607	1.2566	1.5558
Libor 英镑	0.2288	0.2444	0.2671	0.3788	0.5250	0.7473
Libor 欧元	-0.4016	-0.3871	-0.3740	-0.3209	-0.2083	-0.0723

全球汇率

	2016-9-20	2016-9-19	2016-9-16	2016-9-15	2016-9-14	2016-9-13
欧元中间价	7.4484	7.4551	-	-	7.5059	7.5001
日元中间价	6.54	6.5286	-	-	6.5279	6.5549
美元中间价	6.6595	6.6786	-	-	6.6895	6.6726
美元指数	96.0086	95.8503	96.0335	95.2628	95.3221	95.5621
欧元兑美元	1.1152	1.1177	1.1156	1.1245	1.1248	1.1215
美元兑人民币即期	6.6711	6.6716	-	-	6.6711	6.68

各国股市概览

	收盘价	涨跌幅%		收盘价	涨跌幅%
道指	18129.89	0.054	FTSE100	6830.79	0.253
标普 500	2139.76	0.030	日经 225	16492.15	-0.164
德国 DAX	10393.86	0.193	上证综指	3023.00	-0.101
法国 CAC	4388.6	-0.127	深证成指	10544.53	-0.121

国内金融期货前日涨跌

	收盘价	涨跌幅%	持仓量	成交量
IF1610	3214.4	0.06	28929	7777
IF1612	3156.8	0.13	9304	562
TF1612	101.46	0.02	21222	5753
T1612	101.04	0.03	36667	16928

中债国债到期收益率

	1Y	3Y	5Y	7Y	10Y	15Y
2016-9-20	2.1734	2.4278	2.5680	2.7475	2.7431	3.0696
2016-9-19	2.1784	2.4376	2.5699	2.7600	2.7605	3.0814
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

市场资金加权平均利率

	R001. IB	R007. IB	GC001	GC007	IB0001	IB0007
2016-9-20	2.2649	2.6749	3.5645	3.1062	2.2089	2.6627
2016-9-19	2.2726	2.6626	2.6872	2.6354	2.2196	2.5096
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

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 (%)
2016-9-20	160010.IB	101.24	61.30	8.17	9.63	2.7525
	160014.IB	101.21	14.20	6.00	6.74	2.7500
	160210.IB	100.27	238.10	8.02	9.55	3.1450
2016-9-19	160010.IB	101.05	50.30	8.16	9.63	2.7750
	160014.IB	101.18	15.00	6.01	6.74	2.7550
	160210.IB	100.07	241.30	8.01	9.55	3.1695

融资余额

	融资余额	沪市:融资余额	深市:融资余额
2016-9-19	8919.50	4986.36	3940.70
2016-9-14	8895.70	4979.65	3934.15
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

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