

 **金融期货晨报**

期 期：2016年9月22日

期 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：昨日股票市场窄幅波动，成交量继续萎缩，市场人气极度低迷。

凌晨美联储议息会议作出不加息决定，纳指创收盘纪录新高，但12月加息维持较大概率。虽然外盘走势将对国内产生一定影响，但目前市场缺乏热点，国庆节前观望心态较重，整体仍维持区间震荡。建议观望。

国债期货：昨日期债窄幅波动，成交量放大。凌晨，美联储维持利率不变，称年内加息概率增加，符合市场预期，美股美债齐涨，纳指创收盘纪录新高。国内债券市场将受美联储不加息影响，多头情绪将在短期释放。但12月加息仍是大概率事件，同时国内经济数据并未如之前预期的糟糕，期债难以形成趋势性行情。建议今日短线多单操作。

金融期货主要数据一览

全球利率

	0/N	1W	1M	3M	6M	12M
Shibor	2.1670	2.4050	2.7069	2.8009	2.8843	3.0275
Tibor	-	0.0127	0.0000	0.0600	0.1091	0.1309
Libor 美元	0.4221	0.4576	0.5431	0.8659	1.2594	1.5647
Libor 英镑	0.2288	0.2444	0.2684	0.3759	0.5234	0.7451
Libor 欧元	-0.4016	-0.3871	-0.3740	-0.3216	-0.2140	-0.0711

全球汇率

	2016-9-21	2016-9-20	2016-9-19	2016-9-16	2016-9-15	2016-9-14
欧元中间价	7.4396	7.4484	7.4551	-	-	7.5059
日元中间价	6.5666	6.54	6.5286	-	-	6.5279
美元中间价	6.6738	6.6595	6.6786	-	-	6.6895
美元指数	95.5055	96.0086	95.8503	96.0335	95.2628	95.3221
欧元兑美元	1.119	1.1152	1.1177	1.1156	1.1245	1.1248
美元兑人民币即期	6.6713	6.6711	6.6716	-	-	6.6711

各国股市概览

	收盘价	涨跌幅%		收盘价	涨跌幅%
道指	18293.63	0.903	FTSE100	6834.77	0.058
标普 500	2163.12	1.092	日经 225	16807.62	1.913
德国 DAX	10436.49	0.410	上证综指	3025.87	0.095
法国 CAC	4409.55	0.477	深证成指	10583.40	0.369

国内金融期货前日涨跌

	收盘价	涨跌幅%	持仓量	成交量
IF1610	3236.6	0.75	29528	9348
IF1612	3175.8	0.66	9382	596
TF1612	101.465	0.00	21188	6173
T1612	101.035	-0.02	37015	19104

中债国债到期收益率

	1Y	3Y	5Y	7Y	10Y	15Y
2016-9-21	2.1734	2.4378	2.5710	2.7575	2.7518	3.0734
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

市场资金加权平均利率

	R001. IB	R007. IB	GC001	GC007	IB0001	IB0007
2016-9-21	2.2723	2.6823	3.4690	3.3132	2.2093	2.6587
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

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 (%)
2016-9-21	160010.IB	101.05	30.40	8.16	9.62	2.7750
	160014.IB	101.18	9.30	6.00	6.74	2.7550
	160210.IB	100.25	190.40	8.01	9.54	3.1475
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

融资余额

	融资余额	沪市:融资余额	深市:融资余额
2016-9-20	8927.80	4988.67	3942.36
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

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