

 **金融期货晨报**

期 期 : 2016 年 9 月 27 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：昨日股票市场大幅回落，成交量略有上升，沪指跌破 3000 关口，市场信心极度低迷。美国大选造成外围市场出现较大波动，美联储 12 月加息预期强烈。目前国内市场缺乏热点，国庆节前观望心态较重，此次沪指跌破重要关口对市场信心造成较大打击，节前难以恢复。建议观望。

国债期货：昨日期债缩量上涨，银行间国债收益率继续回落，十年期国债收益率至 2.73% 水平。市场资金仍然保持偏紧状态，央行单日净回笼 2450 亿元，创半年最大水平。8 月份 M1 仍保持高速增长，市场资金仍处“活化”状态，宏观面维持资金较低成本，但近期房地产异常现象使得央行短期收紧资金，期债价格难以持续拉升。建议今日观望。

金融期货主要数据一览

全球利率

	0/N	1W	1M	3M	6M	12M
Shibor	2.1640	2.4390	2.7330	2.8040	2.8899	3.0265
Tibor	-	0.0118	0.0000	0.0582	0.1082	0.1300
Libor 美元	0.4232	0.4534	0.5222	0.8529	1.2447	1.5574
Libor 英镑	0.2288	0.2445	0.2669	0.3763	0.5247	0.7458
Libor 欧元	-0.4000	-0.3871	-0.3740	-0.3203	-0.2119	-0.0733

全球汇率

	2016-9-26	2016-9-23	2016-9-22	2016-9-21	2016-9-20	2016-9-19
欧元中间价	7.4986	7.4698	7.4495	7.4396	7.4484	7.4551
日元中间价	6.6155	6.6114	6.6361	6.5666	6.54	6.5286
美元中间价	6.6744	6.667	6.6513	6.6738	6.6595	6.6786
美元指数	95.2986	95.5001	95.3801	95.5055	96.0086	95.8503
欧元兑美元	1.1252	1.1226	1.1207	1.119	1.1152	1.1177
美元兑人民币即期	6.6699	6.67	6.6693	6.6713	6.6711	6.6716

各国股市概览

	收盘价	涨跌幅%		收盘价	涨跌幅%
道指	18094.83	-0.91	FTSE100	6818.04	-1.32
标普 500	2146.1	-0.86	日经 225	16544.56	-1.250
德国 DAX	10393.71	-2.19	上证综指	2980.43	-1.762
法国 CAC	4407.85	-1.8	深证成指	10392.70	-2.045

国内金融期货前日涨跌

	收盘价	涨跌幅%	持仓量	成交量
IF1610	3204.8	-1.42	30879	9949
IF1612	3156	-1.18	9709	827
TF1612	101.575	0.05	21316	4715
T1612	101.25	0.13	39211	13341

中债国债到期收益率

	1Y	3Y	5Y	7Y	10Y	15Y
2016-9-26	2.1534	2.4070	2.5474	2.7350	2.7157	3.0253
2016-9-23	2.1584	2.3980	2.5529	2.7450	2.7318	3.0334
2016-9-22	2.1634	2.4211	2.5639	2.7500	2.7456	3.0641
2016-9-21	2.1734	2.4378	2.5710	2.7575	2.7518	3.0734

市场资金加权平均利率

	R001. IB	R007. IB	GC001	GC007	IB0001	IB0007
2016-9-26	2.2150	2.4930	3.5159	6.1888	2.2231	2.544
2016-9-23	2.1736	2.4207	2.8873	5.1852	2.2149	2.4225
2016-9-22	2.2028	2.6878	5.3363	2.6819	2.2164	2.4606
2016-9-21	2.2723	2.6823	3.4690	3.3132	2.2093	2.6587

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 (%)
2016-9-26	160010.IB	101.38	84.50	8.15	9.61	2.7350
	160014.IB	101.30	28.50	5.99	6.72	2.7350
	160210.IB	100.25	185.80	8.00	9.53	3.1478
2016-9-23	160010.IB	101.19	51.50	8.16	9.62	2.7575
	160014.IB	100.96	32.40	5.99	6.73	2.7900
	160210.IB	100.35	198.50	8.01	9.54	3.1350

融资余额

	融资余额	沪市:融资余额	深市:融资余额
2016-9-23	8880.26	4953.11	3924.78
2016-9-22	8920.90	4955.48	3944.18
2016-9-21	8936.00	4977.69	3948.29
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

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