

 **金融期货晨报**

日期：2016年9月28日

期谚日日谈

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：昨日股票市场尾盘出现反弹，沪指逼近 3000 点位置，成交量略有萎缩。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，在去杠杆限制泡沫的政策下，股指面临较大压力。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：昨日期债高开回落，银行间十年期国债收益率窄幅波动。上午公布的 8 月份工业企业利润大增 19.5%，增速创三年来最高。央行公开市场继续“抽水” 951 亿元，叠加国庆临近，资金面趋紧，利率持续上升。期债仍缺乏方向性，市场心态谨慎。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	2.1660	2.4590	2.7353	2.8025	2.8870	3.0265
Tibor	-	0.0109	0.0000	0.0573	0.1073	0.1291
Libor 美元	0.4243	0.4523	0.5244	0.8529	1.2444	1.5552
Libor 英镑	0.2275	0.2431	0.2663	0.3759	0.5263	0.7492
Libor 欧元	-0.4016	-0.3871	-0.3741	-0.3219	-0.2120	-0.0769

全球汇率

	2016-9-27	2016-9-26	2016-9-23	2016-9-22	2016-9-21	2016-9-20
欧元中间价	7.4973	7.4986	7.4698	7.4495	7.4396	7.4484
日元中间价	6.64	6.6155	6.6114	6.6361	6.5666	6.54
美元中间价	6.6646	6.6744	6.667	6.6513	6.6738	6.6595
美元指数	95.4499	95.2986	95.5001	95.3801	95.5055	96.0086
欧元兑美元	1.1218	1.1252	1.1226	1.1207	1.119	1.1152
美元兑人民币即期	6.6684	6.6699	6.67	6.6693	6.6713	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	101.6	0.02	21551	5674
T1612	101.225	-0.01	38704	13541

中债国债到期收益率

	1Y	3Y	5Y	7Y	10Y	15Y
2016-9-27	2.1684	2.3983	2.5536	2.7387	2.7144	3.0234
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

市场资金加权平均利率

	R001. IB	R007. IB	GC001	GC007	IB0001	IB0007
2016-9-27	2.2714	2.5695	5.5036	7.1786	2.2314	2.5972
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

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 (%)
2016-9-27	160010.IB	101.28	46.90	8.15	9.61	2.7475
	160014.IB	101.33	25.90	5.99	6.72	2.7300
	160210.IB	100.39	236.37	8.00	9.53	3.1300
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

融资余额

	融资余额	沪市:融资余额	深市:融资余额
2016-9-26	8872.27	4949.50	3919.16
2016-9-23	8879.30	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

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