



金融期货晨报

日期：2016年10月10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：节前沪指重回 3000 点，成交量大幅萎缩。经济基本面显示有所企稳，服务业保持稳步增长，但信贷增长的结构特点制约央行货币政策。国际市场出现较大波动，对全球流动性的担忧使得市场分歧较大。国内楼市调控加码，信贷政策收紧，房市资金有望部分流入股市，但股票市场缺乏热点，仍将处于窄幅波动状态。建议观望

国债期货：国庆期间欧美债券市场出现较大波动，市场对 12 月加息预期增强，美国非农不及预期，美债收益率持续走高后小幅回落。央行官员对经济预期的表态显示出未来货币政策将进一步让位于财政政策，受房地产持续过热及中美利差的影响，货币政策难以进一步实质性宽松。节后两个交易日，银行间国债及国开债收益率出现明显回落，今日期债将出现高开，但仍缺乏趋势性机会，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	2.1750	2.4250	2.7300	2.8015	2.8870	3.0275
Tibor	-	0.0091	0.0000	0.0573	0.1064	0.1282
Libor 美元	0.4266	0.4553	0.5290	0.8761	1.2622	1.5871
Libor 英镑	0.2269	0.2499	0.2663	0.3929	0.5466	0.7787
Libor 欧元	-0.4069	-0.3889	-0.3771	-0.3220	-0.2121	-0.0769

全球汇率

	2016-10-7	2016-10-6	2016-10-5	2016-10-4	2016-10-3	2016-9-30
欧元中间价	-	-	-	-	-	7.488
日元中间价	-	-	-	-	-	6.6012
美元中间价	-	-	-	-	-	6.6778
美元指数	96.4912	96.681	96.1463	96.1234	95.7612	95.4426
欧元兑美元	1.12	1.1146	1.1207	1.1205	1.1209	1.124
美元兑人民币即期	-	-	-	-	-	6.67

各国股市概览

	收盘价	涨跌幅%		收盘价	涨跌幅%
道指	18240.08	-0.156	FTSE100	7044.39	0.635
标普 500	2153.74	-0.325	日经 225	16860.09	-0.231
德国 DAX	10490.86	-0.737	上证综指	-	-
法国 CAC	4449.91	-0.674	深证成指	-	-

国内金融期货前日涨跌

	收盘价	涨跌幅%	持仓量	成交量
IF1610	3246	0.18	28841	7931
IF1612	3195.8	0.20	9768	687
TF1612	101.625	0.02	21004	3127
T1612	101.19	0.02	37675	7290

中债国债到期收益率

	1Y	3Y	5Y	7Y	10Y	15Y
2016-10-9	2.16	2.4128	2.5174	2.6949	2.6760	2.9906
2016-10-8	2.1507	2.4138	2.5447	2.7249	2.7047	3.0050
2016-9-30	2.1584	2.4110	2.5489	2.7401	2.7258	3.0223
2016-9-29	2.1684	2.3884	2.5552	2.7450	2.7282	3.0304

市场资金加权平均利率

	R001. IB	R007. IB	GC001	GC007	IB0001	IB0007
2016-10-9	2.0922	2.3109	0.0000	0.0000	2.1853	2.5329
2016-10-8	2.1349	2.3420	0.0000	0.0000	2.2049	2.5885
2016-9-30	2.3414	2.5778	5.5013	0.9371	2.3414	2.5323
2016-9-29	2.3104	2.7583	18.1132	3.2901	2.2606	2.5664

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 (%)
2016-10-9	160010.IB	100.87	16.10	8.11	9.58	2.7961
	160014.IB	101.50	0.20	5.96	6.69	2.7000
	160210.IB	100.83	63.50	7.97	9.49	3.0760
2016-10-8	160010.IB	99.30	33.60	8.08	9.58	2.9848
	160014.IB	101.09	28.40	5.96	6.69	2.7679
	160210.IB	100.68	93.20	7.97	9.50	3.0950

融资余额

	融资余额	沪市:融资余额	深市:融资余额
2016-9-29	8823.69	4853.68	3899.10
2016-9-28	8848.70	4924.59	3910.38
2016-9-27	8863.70	4939.35	3915.22
2016-9-26	8871.30	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

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