

 **金融期货晨报**

期 期 : 2016 年 10 月 13 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：**昨日股指小幅回落，量能较前两个交易日明显萎缩，上证综指波动率创 14 年的新低。外围股市表现不佳，国内获利回吐意愿的抬头，大盘存在较大的调整压力，观望情绪开始加重。市场仍处是存量资金博弈状态，缺乏增量资金进入，维持区间震荡状态。建议观望

**国债期货：**期债震荡回落，银行间国债收益率持续反弹，10 年前国债收益率逼近节前位置，上午 10 年国债招标情况稳定。央行继续净回笼资金，去杠杆政策持续。近期人民币持续贬值，中间价至 6.7258，国际市场对流动性拐点担忧加剧。短期期债仍缺乏方向性，维持区间震荡。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	2.1500	2.3830	2.7148	2.8015	2.8870	3.0275
Tibor	-	0.0091	0.0000	0.0573	0.1064	0.1282
Libor 美元	0.4277	0.4564	0.5307	0.8775	1.2635	1.5912
Libor 英镑	0.2294	0.2483	0.2669	0.3956	0.5549	0.7865
Libor 欧元	-0.4069	-0.3889	-0.3771	-0.3204	-0.2119	-0.0783

## 全球汇率

	2016-10-12	2016-10-11	2016-10-10	2016-10-7	2016-10-6	2016-10-5
欧元中间价	7.4366	7.4748	7.4894	-	-	-
日元中间价	6.5096	6.474	6.4964	-	-	-
美元中间价	6.7258	6.7098	6.7008	-	-	-
美元指数	98.0003	97.7289	96.9018	96.4912	96.681	96.1463
欧元兑美元	1.1007	1.1052	1.1139	1.12	1.1146	1.1207
美元兑人民币即期	6.7139	6.7148	6.7028	-	-	-

## 各国股市概览

	收盘价	涨跌幅%		收盘价	涨跌幅%
道指	18145.99	0.096	FTSE100	7024.01	-0.663
标普 500	2139.17	0.114	日经 225	16840	-1.085
德国 DAX	10523.07	-0.511	上证综指	3058.50	-0.220
法国 CAC	4452.24	-0.436	深证成指	10788.59	0.058

## 国内金融期货前日涨跌

	收盘价	涨跌幅%	持仓量	成交量
IF1610	3289.8	-0.12	27442	6935
IF1612	3234.4	-0.21	10072	615
TF1612	101.77	-0.02	21273	4406
T1612	101.435	-0.09	38932	13177

## 中债国债到期收益率

	1Y	3Y	5Y	7Y	10Y	15Y
2016-10-12	2.159	2.3978	2.5197	2.7032	2.7098	3.0151
2016-10-11	2.1513	2.3980	2.5140	2.6925	2.6835	2.9971
2016-10-10	2.1487	2.3980	2.5134	2.6850	2.6735	2.9894
2016-10-9	2.16	2.4128	2.5174	2.6949	2.6760	2.9906

## 市场资金加权平均利率

	R001. IB	R007. IB	GC001	GC007	IB0001	IB0007
2016-10-12	2.1399	2.4125	2.3939	2.5748	2.2017	2.4578
2016-10-11	2.1195	2.3831	3.0408	2.7522	2.1909	2.3964
2016-10-10	2.1173	2.4333	3.1028	2.6872	2.2168	2.521
2016-10-9	2.0922	2.3109	0.0000	0.0000	2.1853	2.5329

## 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 (%)
2016-10-12	160010.IB	101.38	56.60	8.11	9.57	2.7350
	160014.IB	101.50	20.40	5.95	6.68	2.7000
	160210.IB	100.60	297.26	7.96	9.48	3.1050
2016-10-11	160010.IB	101.53	45.40	8.11	9.57	2.7175
	160014.IB	101.62	18.80	5.95	6.68	2.6808
	160210.IB	100.78	277.60	7.97	9.49	3.0820

## 融资余额

	融资余额	沪市:融资余额	深市:融资余额
2016-10-11	8828.97	4955.54	3897.41
2016-10-10	8784.50	4931.56	3882.79
2016-9-30	8685.40	4901.32	3832.98
2016-9-29	8822.60	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

## 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