

 **金融期货晨报**

期 期：2016 年 10 月 14 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：昨日股指窄幅震荡，成交量略有放大，期指维持窄幅波动。昨日公布的 9 月出口远不如预期，人民币中间价继续贬值，观望保持较重观望情绪。市场无法形成热点题材，宏观经济降杠杆的政策降低市场风险偏好，抑制资金流入股市，股市处存量资金博弈状态，缺乏增量资金进入，维持区间震荡状态。建议观望

国债期货：期债小幅反弹，受 9 月出口数据大幅不及预期的影响，银行间国债收益率出现回落，10 年期国债收益率较昨日收盘回落约 1BP。央行持续净回笼资金，银行间 7 天质押式回购利率继续反弹。基本面及政策面未有变化，市场心态仍然谨慎，期债将维持区间震荡。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	2.1510	2.3780	2.7125	2.8025	2.8877	3.0275
Tibor	-	0.0091	0.0000	0.0573	0.1064	0.1282
Libor 美元	0.4288	0.4587	0.5346	0.8811	1.2637	1.5957
Libor 英镑	0.2306	0.2489	0.2666	0.3956	0.5561	0.7918
Libor 欧元	-0.4069	-0.3889	-0.3771	-0.3227	-0.2134	-0.0799

全球汇率

	2016-10-13	2016-10-12	2016-10-11	2016-10-10	2016-10-7	2016-10-6
欧元中间价	7.4108	7.4366	7.4748	7.4894	-	-
日元中间价	6.4521	6.5096	6.474	6.4964	-	-
美元中间价	6.7296	6.7258	6.7098	6.7008	-	-
美元指数	97.535	98.0003	97.7289	96.9018	96.4912	96.681
欧元兑美元	1.1054	1.1007	1.1052	1.1139	1.12	1.1146
美元兑人民币即期	6.7299	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	18100.24	-0.242	FTSE100	6977.74	-0.659
标普 500	2132.55	-0.310	日经 225	16774.24	-0.390
德国 DAX	10414.07	-1.036	上证综指	3061.35	0.093
法国 CAC	4405.17	-1.057	深证成指	10787.49	-0.010

国内金融期货前日涨跌

	收盘价	涨跌幅%	持仓量	成交量
IF1610	3287.2	0.04	26964	8419
IF1612	3230.2	-0.05	10202	626
TF1612	101.785	0.09	20960	4389
T1612	101.41	0.13	40710	12475

中债国债到期收益率

	1Y	3Y	5Y	7Y	10Y	15Y
2016-10-13	2.1467	2.3887	2.5263	2.7000	2.7010	3.0070
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

市场资金加权平均利率

	R001. IB	R007. IB	GC001	GC007	IB0001	IB0007
2016-10-13	2.1478	2.4378	3.5424	2.2843	2.2008	2.4109
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

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 (%)
2016-10-13	160017.IB	100.30	72.70	8.40	9.81	2.7050
	160020.IB	100.43	16.50	6.19	6.89	2.6800
	160210.IB	100.64	240.80	7.96	9.48	3.1000
2016-10-12	160017.IB	100.60	0.00	8.41	9.82	2.6700
	160020.IB	100.31	56.20	6.19	6.89	2.7000
	160210.IB	100.60	297.26	7.96	9.48	3.1050

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