



# 金融期货晨报

日期：2016年10月18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：**昨日上证 B 股指数大跌 6.15%，深证 B 指下跌 2.43%，受此影响，A 股昨日午后也出现跳水，最终上证综指收跌 0.74%，结束此前的七连阳。多数观点认为 B 股自身发展方向不明，流动性较弱，人民币的持续性下跌导致资金出现踩踏离场。股市基本面依然偏稳，但不确定因素增加，流动性面临递减，大盘一直处于窄幅整理状态，难以出现流畅行情。建议观望。

**国债期货：**昨日国债期货震荡上行，成交量萎缩。银行间国债收益率窄幅波动，央行持续净回笼资金，债券及货币政策保持平稳。本周将公布更多重要经济数据，加之人民币贬值压力及前期超预期的通胀数据等，市场分歧加大，期债将维持窄幅震荡。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	2.1590	2.3750	2.7101	2.8040	2.8870	3.0275
Tibor	-	0.0091	0.0000	0.0573	0.1064	0.1282
Libor 美元	0.4304	0.4592	0.5357	0.8817	1.2623	1.5857
Libor 英镑	0.2294	0.2511	0.2663	0.4013	0.5596	0.7999
Libor 欧元	-0.4040	-0.3889	-0.3786	-0.3234	-0.2147	-0.0813

## 全球汇率

	2016-10-17	2016-10-14	2016-10-13	2016-10-12	2016-10-11	2016-10-10
欧元中间价	7.3883	7.4229	7.4108	7.4366	7.4748	7.4894
日元中间价	6.4723	6.4788	6.4521	6.5096	6.474	6.4964
美元中间价	6.7379	6.7157	6.7296	6.7258	6.7098	6.7008
美元指数	97.8774	98.1056	97.535	98.0003	97.7289	96.9018
欧元兑美元	1.0999	1.0966	1.1054	1.1007	1.1052	1.1139
美元兑人民币即期	6.7396	6.7255	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	18085.82	-0.290	FTSE100	6947.55	-0.941
标普 500	2126.5	-0.304	日经 225	16900.12	0.260
德国 DAX	10503.57	-0.726	上证综指	3041.17	-0.739
法国 CAC	4450.23	-0.463	深证成指	10651.50	-1.005

## 国内金融期货前日涨跌

	收盘价	涨跌幅%	持仓量	成交量
IF1610	3271	-0.67	21683	10665
IF1612	3214	-0.63	10474	853
TF1612	101.88	0.07	21076	4545
T1612	101.53	0.06	40557	11840

## 中债国债到期收益率

	1Y	3Y	5Y	7Y	10Y	15Y
2016-10-17	2.1495	2.3884	2.4694	2.6658	2.6904	2.9929
2016-10-14	2.1381	2.3780	2.4677	2.6728	2.6952	3.0003
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

## 市场资金加权平均利率

	R001. IB	R007. IB	GC001	GC007	IB0001	IB0007
2016-10-17	2.1955	2.4579	2.5332	2.6043	2.1959	2.5272
2016-10-14	2.1572	2.3976	2.5019	2.4250	2.2038	2.4275
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

## 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 (%)
2016-10-17	160017.IB	100.34	248.10	8.39	9.80	2.7000
	160020.IB	100.50	20.40	6.18	6.88	2.6694
	160210.IB	100.76	196.80	7.95	9.47	3.0850
2016-10-14	160017.IB	100.45	54.70	8.40	9.81	2.6875
	160020.IB	100.48	12.40	6.18	6.88	2.6725
	160210.IB	100.10	247.80	7.95	9.48	3.1661

## 融资余额

	融资余额	沪市:融资余额	深市:融资余额
2016-10-14	8896.78	4980.29	3932.65
2016-10-13	8903.10	4964.13	3930.93
2016-10-12	8873.50	4973.10	3918.64
2016-10-11	8828.00	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

## 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