

 **金融期货晨报**

期 期：2016 年 10 月 20 日

期 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：昨日股指低开反弹，三季度经济数据公布后市场反应平稳。经济企稳迹象更加明显，基本面对指数支撑增强，沪指年线至 3100 点一线阻力位成为关键。从成交量来看，目前市场还没有打破存量博弈的格局，反弹阻力增大。建议日内短多操作。

国债期货：昨日期债放量上涨，公布三季度经济数据，总体符合预期，银行间资金面转松，加之配置力量依然较强，国债招标利率低于预期，银行间 10 年国债收益率回落 3BP。市场对未来经济预期仍偏悲观，特别是对明年经济能否企稳的怀疑主导期债运行，但三季度经济出现企稳迹象，短期 TF1612 缺乏持续上行动力，成交较 9 月明星偏低，市场仍偏谨慎。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	2.1730	2.3810	2.7121	2.8040	2.8870	3.0275
Tibor	-	0.0091	0.0000	0.0573	0.1064	0.1282
Libor 美元	0.4332	0.4603	0.5279	0.8776	1.2643	1.5807
Libor 英镑	0.2294	0.2508	0.2651	0.4010	0.5664	0.8121
Libor 欧元	-0.4069	-0.3889	-0.3786	-0.3234	-0.2147	-0.0813

全球汇率

	2016-10-19	2016-10-18	2016-10-17	2016-10-14	2016-10-13	2016-10-12
欧元中间价	7.3938	7.4095	7.3883	7.4229	7.4108	7.4366
日元中间价	6.4856	6.4844	6.4723	6.4788	6.4521	6.5096
美元中间价	6.7326	6.7303	6.7379	6.7157	6.7296	6.7258
美元指数	97.8686	97.8764	97.8774	98.1056	97.535	98.0003
欧元兑美元	1.0973	1.0978	1.0999	1.0966	1.1054	1.1007
美元兑人民币即期	6.7393	6.7393	6.7396	6.7255	6.7299	6.7139

各国股市概览

	收盘价	涨跌幅%		收盘价	涨跌幅%
道指	18203.1	0.227	FTSE100	7021.92	0.312
标普 500	2144.29	0.219	日经 225	16998.91	0.208
德国 DAX	10645.68	0.133	上证综指	3084.72	0.027
法国 CAC	4520.3	0.253	深证成指	10757.92	-0.362

国内金融期货前日涨跌

	收盘价	涨跌幅%	持仓量	成交量
IF1610	3312.8	-0.06	11501	9822
IF1612	3257.8	0.04	11070	1010
TF1612	101.965	0.12	21271	6672
T1612	101.66	0.19	41130	15557

中债国债到期收益率

	1Y	3Y	5Y	7Y	10Y	15Y
2016-10-19	2.1361	2.3087	2.4351	2.652	2.6664	2.9747
2016-10-18	2.1446	2.3191	2.4631	2.6688	2.6965	2.9960
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

市场资金加权平均利率

	R001. IB	R007. IB	GC001	GC007	IB0001	IB0007
2016-10-19	2.2647	2.5061	2.78	2.708	2.2141	2.4992
2016-10-18	2.3068	2.7347	2.9587	2.8575	2.1959	2.5272
2016-10-17	2.1955	2.4579	2.5332	2.6043	2.2038	2.4275
2016-10-14	2.1572	2.3976	2.5019	2.4250	2.2008	2.4109

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 (%)
2016-10-19	160017.IB	100.77	79.30	8.40	9.80	2.6500
	160020.IB	100.55	12.54	6.17	6.87	2.6600
	160210.IB	100.79	182.80	7.95	9.47	3.0810
2016-10-18	160017.IB	100.40	92.38	8.39	9.80	2.6925
	160020.IB	100.54	16.72	6.17	6.87	2.6625
	160210.IB	100.79	163.90	7.95	9.47	3.0810

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