

 金融期货晨报

期 期：2016年10月21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，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，两融余额持续回升，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。建议观望。

国债期货：昨日银行间现券收益率继续回落，降幅收窄，期债明显走高。近日市场资金利率走高，但市场传言外资机构配置踊跃，国内配置力量持续较强，利率债收益率整体下行。资产荒背景下配置需求犹在，市场担忧经济改善持续性，均利多债市，但在货币转向中性，经济出现企稳迹象，人民币贬值压力持续，收益率下行幅度有限；债券成本收益出现倒挂，在货币政策缺乏宽松基础的情况下，收益率继续下行依赖于资本利得，期债上涨持续性缺乏基础。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	2.2080	2.3970	2.7213	2.8054	2.8889	3.0280
Tibor	-	0.0091	0.0000	0.0573	0.1064	0.1282
Libor 美元	0.4338	0.4576	0.5246	0.8807	1.2557	1.5640
Libor 英镑	0.2281	0.2510	0.2635	0.4058	0.5644	0.8034
Libor 欧元	-0.4069	-0.3889	-0.3786	-0.3236	-0.2150	-0.0814

全球汇率

	2016-10-20	2016-10-19	2016-10-18	2016-10-17	2016-10-14	2016-10-13
欧元中间价	7.3866	7.3938	7.4095	7.3883	7.4229	7.4108
日元中间价	6.5068	6.4856	6.4844	6.4723	6.4788	6.4521
美元中间价	6.7311	6.7326	6.7303	6.7379	6.7157	6.7296
美元指数	98.3289	97.8686	97.8764	97.8774	98.1056	97.535
欧元兑美元	1.0924	1.0973	1.0978	1.0999	1.0966	1.1054
美元兑人民币即期	6.7396	6.7393	6.7393	6.7396	6.7255	6.7299

各国股市概览

	收盘价	涨跌幅%		收盘价	涨跌幅%
道指	18162.22	-0.222	FTSE100	7026.9	0.071
标普 500	2141.34	-0.138	日经 225	17235.5	1.392
德国 DAX	10701.39	0.523	上证综指	3084.46	-0.008
法国 CAC	4540.12	0.438	深证成指	10784.33	0.245

国内金融期货前日涨跌

	收盘价	涨跌幅%	持仓量	成交量
IF1610	3317.4	0.13	5195	7751
IF1612	3262.8	0.22	11342	820
TF1612	102.115	0.15	21619	6930
T1612	101.89	0.22	40444	16958

中债国债到期收益率

	1Y	3Y	5Y	7Y	10Y	15Y
2016-10-20	2.1361	2.2926	2.4271	2.6240	2.6518	2.9474
2016-10-19	2.1361	2.3087	2.4351	2.6520	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

市场资金加权平均利率

	R001. IB	R007. IB	GC001	GC007	IB0001	IB0007
2016-10-20	2.3013	2.8396	4.9859	2.6465	2.2505	2.5686
2016-10-19	2.3290	2.7812	2.7808	2.7122	2.2496	2.6508
2016-10-18	2.3068	2.7347	2.9587	2.8575	2.2288	2.6167
2016-10-17	2.1955	2.4579	2.5332	2.6043	2.1959	2.5272

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 (%)
2016-10-20	160017.IB	100.83	106.30	8.39	9.79	2.6425
	160020.IB	100.93	17.10	6.17	6.87	2.6000
	160210.IB	101.00	234.70	7.95	9.46	3.0550
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

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