

## 金融期货晨报

期 期 : 2016 年 10 月 26 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：**昨日股票市场小幅震荡，成交量萎缩，市场板块出现分化。三季度数据显示经济目前企稳是支持指数上升的重要因素，四季度基建投资继续发力，经济有望继续企稳。但经济压力仍然较大，汇率因素制约货币政策，财政政策及投资能否顺利跟进存在不确定性。沪指逼近震荡区间顶部，指数上行压力加大。建议观望

**国债期货：**昨日期债震荡回落，国债收益率继续上行，市场资金利率维持高位，中长债成本收益仍然倒挂。上午国开债招标情况稳定，收益率低于二级市场，但市场传言表外理财拟纳入 MPA 考核，若信息属实，表外理财规模影响会较大，期债仍有下跌空间，但基本面仍不支撑趋势性行情，短期转为弱震荡。建议观望为主，短线可轻仓试空。

# 金融期货主要数据一览

## 全球利率

	0/N	1W	1M	3M	6M	12M
Shibor	2.2380	2.4040	2.7265	2.8140	2.8930	3.0300
Tibor	-	0.0091	0.0000	0.0573	0.1064	0.1282
Libor 美元	0.4321	0.4559	0.5340	0.8837	1.2557	1.5707
Libor 英镑	0.2294	0.2505	0.2625	0.4013	0.5619	0.7999
Libor 欧元	-0.4069	-0.3889	-0.3800	-0.3229	-0.2157	-0.0786

## 全球汇率

	2016-10-25	2016-10-24	2016-10-21	2016-10-20	2016-10-19	2016-10-18
欧元中间价	7.364	7.3604	7.3744	7.3866	7.3938	7.4095
日元中间价	6.4922	6.5137	6.4885	6.5068	6.4856	6.4844
美元中间价	6.7744	6.769	6.7558	6.7311	6.7326	6.7303
美元指数	98.7254	98.7556	98.6259	98.3289	97.8686	97.8764
欧元兑美元	1.0888	1.0873	1.0884	1.0924	1.0973	1.0978
美元兑人民币即期	6.7778	6.7718	6.7599	6.7396	6.7393	6.7393

## 各国股市概览

	收盘价	涨跌幅%		收盘价	涨跌幅%
道指	18169.27	-0.3	FTSE100	7017.64	0.45
标普 500	2143.16	-0.38	日经 225	17365.25	0.759
德国 DAX	10757.31	-0.04	上证综指	3131.94	0.118
法国 CAC	4540.84	-0.26	深证成指	10871.51	0.266

## 国内金融期货前日涨跌

	收盘价	涨跌幅%	持仓量	成交量
IF1611	3338.80	-0.21	27438	7215
IF1612	3318.00	-0.19	12225	899
TF1612	101.84	-0.11	20002	9873
T1612	101.50	-0.15	38347	21481

## 中债国债到期收益率

	1Y	3Y	5Y	7Y	10Y	15Y
2016-10-25	2.1493	2.3025	2.4090	2.6110	2.6859	2.9752
2016-10-24	2.1593	2.3177	2.4124	2.5989	2.6595	2.9487
2016-10-21	2.1461	2.3024	2.4056	2.5903	2.6451	2.9366
2016-10-20	2.1361	2.2926	2.4271	2.6240	2.6518	2.9474

## 市场资金加权平均利率

	R001. IB	R007. IB	GC001	GC007	IB0001	IB0007
2016-10-25	2.4823	2.7166	4.1042	3.4787	2.3345	2.742
2016-10-24	2.3296	2.8359	4.0167	3.2282	2.2846	2.625
2016-10-21	2.3970	2.9090	4.3881	2.9763	2.2769	2.6394
2016-10-20	2.3013	2.8396	4.9859	2.6465	2.2505	2.5686

## 活跃 CTD 券情况

		收盘价	成交量 (亿元)	修正久期 (年)	到期收益 率 (%)	收益率涨跌 (BP)
2016-10-24	160017.IB	100.58	67.60	8.38	2.6725	0.25
	160020.IB	101.11	25.50	6.16	2.5700	-0.50
	160210.IB	100.61	346.80	7.93	3.1025	1.25
2016-10-21	160017.IB	100.60	86.50	8.38	2.6700	2.50
	160020.IB	101.08	18.20	6.16	2.5750	0.50
	160210.IB	100.72	257.50	7.93	3.0900	2.90

## 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