

## 金融期货晨报

日期：2016年10月28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，成交量继续萎缩。养老金入市、深港通开通在即、经济工作会议来临等利好对指数具有支撑作用。沪指在 3140 点下方受阻，对未来经济的不确定使得市场仍缺乏信心，在基本面平稳的情况下，指数转入震荡。建议观望

**国债期货：**昨日期债出现反弹，成交量略有回落，10 年期国债收益率回落约 2BP，午后市场资金利率回落，加之央行对 MPA 表态提振市场。人民币贬值压力制约货币政策，虽然央行本周持续净投放资金，但资金仍趋紧，月末因素叠加外汇占款回落导致市场出现流动性紧张。此外，央行降杠杆及稳汇率的举措也使得其缺乏意愿大量提供流动性支持。近期利空因素仍未消退，资金面虽有好转，但将维持紧平衡，国债收益率下行难度加大。期债波动加大，缺乏趋势性行情。建议中线观望为主，日内空单操作。

# 金融期货主要数据一览

## 全球利率

	0/N	1W	1M	3M	6M	12M
Shibor	2.2540	2.4110	2.7365	2.8207	2.8950	3.0310
Tibor	-	0.0091	0.0000	0.0573	0.1064	0.1282
Libor 美元	0.4343	0.4559	0.5348	0.8904	1.2610	1.5796
Libor 英镑	0.2294	0.2467	0.2638	0.4024	0.5638	0.8065
Libor 欧元	-0.4069	-0.3889	-0.3800	-0.3236	-0.2157	-0.0786

## 全球汇率

	2016-10-27	2016-10-26	2016-10-25	2016-10-24	2016-10-21	2016-10-20
欧元中间价	7.3876	7.3707	7.364	7.3604	7.3744	7.3866
日元中间价	6.4751	6.5026	6.4922	6.5137	6.4885	6.5068
美元中间价	6.7736	6.7705	6.7744	6.769	6.7558	6.7311
美元指数	98.916	98.6148	98.7254	98.7556	98.6259	98.3289
欧元兑美元	1.0897	1.0907	1.0888	1.0873	1.0884	1.0924
美元兑人民币即期	6.7778	6.7686	6.7778	6.7718	6.7599	6.7396

## 各国股市概览

	收盘价	涨跌幅%		收盘价	涨跌幅%
道指	18169.68	-0.163	FTSE100	6986.57	0.409
标普 500	2133.04	-0.299	日经 225	17336.42	-0.319
德国 DAX	10717.08	0.069	上证综指	3112.35	-0.127
法国 CAC	4533.57	-0.022	深证成指	10788.97	-0.264

## 国内金融期货前日涨跌

	收盘价	涨跌幅%	持仓量	成交量
IF1611	3324.60	-0.20	27617	8062
IF1612	3301.00	-0.23	12460	904
TF1612	101.88	0.23	18910	7008
T1612	101.52	0.29	35883	22811

## 中债国债到期收益率

	1Y	3Y	5Y	7Y	10Y	15Y
2016-10-27	2.187	2.3489	2.4460	2.6622	2.7068	2.9953
2016-10-26	2.1803	2.3385	2.4556	2.6549	2.7200	3.0092
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

## 市场资金加权平均利率

	R001. IB	R007. IB	GC001	GC007	IB0001	IB0007
2016-10-27	2.4595	3.2142	12.4456	4.2011	2.2953	2.9054
2016-10-26	2.4352	2.8852	5.0903	4.0592	2.3001	2.7115
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

## 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)
2016-10-27	160017.IB	100.17	108.40	8.36	2.7195	0.45
	160020.IB	100.60	40.90	6.15	2.6525	8.26
	160210.IB	100.59	277.20	7.92	3.1050	-2.50
2016-10-26	160017.IB	100.21	149.20	8.37	2.7150	4.25
	160020.IB	101.11	0.00	6.16	2.5699	-0.01
	160210.IB	100.39	376.80	7.92	3.1300	2.75

## 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