



依托大地 共创未来

# 大地期货金融晨报

Office  
Application  
System



## 金融期货晨报

日期：2016年12月9日

姓名：黄浩

联系方式 057186774106

### 观点与策略

**股指期货：**昨日股指小幅高开后并未延续前一交易日的反弹走势，午后大盘继续震荡，临近尾盘时沪指快速跳水翻绿。近期股指连续缩量震荡，下方资金护盘，总体下跌空间有限。但从反弹动力来看，目前存量博弈阶段也难有资金推动股指出现大幅回升。举牌概念之后，市场开始寻找新的热点，高送转等题材股开始发力，随着深港通开启和养老金入市；关注市场量能及蓝筹股企稳情况。建议轻仓试多。

**国债期货：**昨日期债高开回落，市场资金面平稳，DR007 回落至 2.36%，前期债市抛售后，恐慌情绪有所缓解，市场趋于谨慎。货币政策保持稳健，央行保持适量流动性投放，降杠杆仍是目前主要目标。预计随着资金逐步平稳，短期债基赎回潮过后，期债将进入弱势震荡。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	2.2908	2.4908	3.0300	3.1144	3.1399	3.2310
Tibor	-	0.0091	0.0000	0.0573	0.1064	0.1282
Libor 美元	0.4337	0.4938	0.6542	0.9508	1.2932	1.6451
Libor 英镑	0.2263	0.2465	0.2594	0.3794	0.5425	0.7928
Libor 欧元	-0.4100	-0.3939	-0.3857	-0.3371	-0.2230	-0.0840

### 全球汇率

	2016-12-8	2016-12-7	2016-12-6	2016-12-5	2016-12-2	2016-12-1
欧元中间价	7.3953	7.3738	7.388	7.2709	7.3378	7.3111
日元中间价	6.0453	6.0384	6.0316	6.0792	6.0373	6.0351
美元中间价	6.8731	6.8808	6.8575	6.887	6.8794	6.8958
美元指数	101.099	100.2326	100.4803	100.1328	100.6946	100.9476
欧元兑美元	1.0613	1.0752	1.0716	1.0764	1.067	1.066
美元兑人民币即期	6.8799	6.885	6.8762	6.8861	6.8818	6.8949

### 各国股市概览

	收盘价	涨跌幅%		收盘价	涨跌幅%
道指	19626.01	0.39	FTSE100	6931.55	0.42
标普 500	2246.8	0.24	日经 225	18765.47	1.45
德国 DAX	11179.42	1.75	上证综指	3215.37	-0.21
法国 CAC	4735.48	0.87	深证成指	10812.30	-0.40

### 国内金融期货前日涨跌

	收盘价	涨跌幅%	持仓量	成交量
IF1612	3458.60	-0.02	24825	8869
IF1703	3389.80	-0.12	6685	1189
TF1703	99.50	0.03	25109	10314
T1703	97.81	0.10	49215	37756

依托大地 共创未来

总部地址: 杭州市延安路 511 号元通大厦 12 楼 邮编: 310006 客服热线: 40088-40077

Headquarters Address: 12/F, Yuantong Mansion, 511Yan'an Road, Hangzhou P. C. 310006

## 中债国债到期收益率

	1Y	3Y	5Y	7Y	10Y	15Y
2016-12-8	2.44	2.6701	2.8635	3.0600	3.0753	3.3387
2016-12-7	2.3984	2.6722	2.8955	3.0855	3.0877	3.3475
2016-12-6	2.3702	2.6654	2.9062	3.1110	3.1151	3.3719
2016-12-5	2.3974	2.6216	2.8131	3.0222	3.0302	3.2883

## 市场资金加权平均利率

	R001. IB	R007. IB	GC001	GC007	IB0001	IB0007
2016-12-8	2.2532	2.5884	4.5800	2.8051	2.3297	2.6362
2016-12-7	2.2509	2.5843	2.6060	2.9056	2.3379	2.6776
2016-12-6	2.2595	2.5454	2.8989	2.9305	2.3508	2.5985
2016-12-5	2.2617	2.5537	2.9044	2.9916	2.3584	2.6822

## 活跃 CTD 券情况

		成交量 (亿元)	修正久期(年)	到期收益率(%)	收益率涨跌(BP)
2016-12-8	160017.IB	106.15	8.20	3.1200	2.50
	160020.IB	12.10	6.01	3.0550	-6.00
	160210.IB	288.30	7.77	3.4400	0.00
2016-12-7	160017.IB	70.94	8.20	3.0950	0.50
	160020.IB	6.40	6.00	3.1150	-0.50
	160210.IB	279.20	7.77	3.4400	-0.50

## 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 号海关大楼一楼东首	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	北京市海淀区万寿路 2 号西翠宾馆 601、603 房间	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

----- 依托大地 共创未来 -----

总部地址：杭州市延安路 511 号元通大厦 12 楼 邮编：310006 客服热线：40088-40077

Headquarters Address: 12/F, Yuantong Mansion, 511Yan'an Road, Hangzhou P. C. 310006