



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13日

姓名：黄浩

联系方式 057186774106

### 观点与策略

**股指期货：**昨日股指大幅回落，沪指尾盘险守 3150 点，成交量大幅增加。新股发行大提速令市场承压，高估值创业板持续下行打击市场信心，监管紧盯炒作风潮，高送转、妖股等持续引起监管注意，市场以较为情绪化的方式回应了近期监管层的种种举措。随着年末临近，市场资金面紧张，昨日大跌严重打击市场信心。但此次市场杀跌以“中小创”为主，后续掘进方向仍应围绕蓝筹品种展开。建议观望。

**国债期货：**昨日国债期货跌幅再创新高，主力合约跌幅超过 1 元，CTD 券 160023.IB 到期收益率上涨 7BP。债券市场方面，基金净流出加大，虽然市场资金利率连续一周保持平稳，但赎回压力迫使基金大量离场。期现价差负值继续扩大，T1703 IRR 水平回落至-6%，期货贴水严重。10 年前国债收益率回升至年内高位，而资金面紧张程度缓解，基金赎回压力迫使收益率上行，国债继续下跌缺乏基本面支撑，期债大幅贴水存在短期过度悲观情绪。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	2.2920	2.4940	3.0756	3.1377	3.1464	3.2460
Tibor	-	0.0091	0.0000	0.0573	0.1064	0.1282
Libor 美元	0.4342	0.6082	0.6800	0.9565	1.2960	1.6484
Libor 英镑	0.2263	0.2406	0.2589	0.3769	0.5401	0.7911
Libor 欧元	-0.4100	-0.3931	-0.3829	-0.3336	-0.2201	-0.0863

### 全球汇率

	2016-12-12	2016-12-9	2016-12-8	2016-12-7	2016-12-6	2016-12-5
欧元中间价	7.2842	7.3171	7.3953	7.3738	7.388	7.2709
日元中间价	5.9906	6.0433	6.0453	6.0384	6.0316	6.0792
美元中间价	6.9086	6.8972	6.8731	6.8808	6.8575	6.887
美元指数	100.9659	101.5704	101.099	100.2326	100.4803	100.1328
欧元兑美元	1.0636	1.056	1.0613	1.0752	1.0716	1.0764
美元兑人民币即期	6.9152	6.9005	6.8799	6.885	6.8762	6.8861

### 各国股市概览

	收盘价	涨跌幅%		收盘价	涨跌幅%
道指	19756.85	0.72	FTSE100	6954.21	0.33
标普 500	2259.53	0.59	日经 225	19155.03	0.84
德国 DAX	11203.63	0.22	上证综指	3152.97	-2.47
法国 CAC	4764.07	0.60	深证成指	10302.85	-4.51

### 国内金融期货前日涨跌

	收盘价	涨跌幅%	持仓量	成交量
IF1612	3390.40	-2.50	20282	12652
IF1703	3317.20	-2.75	7931	1502
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
2016-12-12	2.5744	2.7132	2.9043	3.1067	3.1458	3.3989
2016-12-9	2.5096	2.6895	2.8413	3.0578	3.0853	3.3436
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

## 市场资金加权平均利率

	R001. IB	R007. IB	GC001	GC007	IB0001	IB0007
2016-12-12	2.2692	2.6105	2.8756	2.9947	2.3325	2.6344
2016-12-9	2.2445	2.5680	2.7407	2.9009	2.3223	2.6117
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

## 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)
2016-12-12	160017.IB	58.00	8.18	3.1400	5.50
	160020.IB	9.60	5.99	3.0907	3.57
	160210.IB	251.50	7.75	3.4502	-0.34
2016-12-9	160017.IB	40.80	8.20	3.0850	-3.50
	160020.IB	17.20	6.00	3.0550	0.00
	160210.IB	289.60	7.76	3.4536	1.36

## 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