



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23日

姓名：黄浩

联系方式 057186774106

观点与策略

股指期货：昨日 A 股偏弱震荡，沪指尾盘勉强翻红，中小、创两综指微跌，期指主力合约均小幅回落，经过前一交易日的反弹，后续跟进买盘目前比较犹豫，债市信用危机缓解有望减少资金面担忧，但此轮央行注资为短期行为，待债市稳定后流动性仍然趋紧。年末将至，市场维持弱势震荡格局，市场量能不足，反弹力度有限，建议短多操作。

国债期货：昨日期债大幅反弹，成交量保持高位，随着国海事件结束，市场恐慌情绪消退，央行加大流动性投放力度，市场流动性紧张态势缓解，银行间国债收益率持续回落，十年期国债收益率至 3.18%，T1703 仍保持较大幅度贴水，短线存反弹动力。但年末将至，市场资金难以宽松，且明年表外理财纳入 MPA，货币政策边际收紧，监管加强，期债进入宽幅震荡，反弹空间有限，预计今日反弹力度将大幅减弱。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	2.3410	2.5440	3.2371	3.2267	3.2442	3.3455
Tibor	-	0.0091	0.0000	0.0573	0.1064	0.1282
Libor 美元	0.6860	0.7078	0.7550	0.9976	1.3160	1.6896
Libor 英镑	0.2275	0.2409	0.2536	0.3621	0.5345	0.7943
Libor 欧元	-0.4100	-0.3903	-0.3800	-0.3336	-0.2266	-0.0863

全球汇率

	2016-12-22	2016-12-21	2016-12-20	2016-12-19	2016-12-16	2016-12-15
欧元中间价	7.245	7.227	7.2306	7.2655	7.2372	7.2694
日元中间价	5.9085	5.9014	5.9366	5.9051	5.8809	5.9068
美元中间价	6.9435	6.9489	6.9468	6.9312	6.9508	6.9289
美元指数	103.0759	103.0385	103.3035	103.1349	102.8025	103.1514
欧元兑美元	1.0436	1.0424	1.0388	1.0402	1.0451	1.0412
美元兑人民币即期	6.9466	6.9512	6.9509	6.945	6.9547	6.9354

各国股市概览

	收盘价	涨跌幅%		收盘价	涨跌幅%
道指	19918.88	-0.12	FTSE100	7063.68	0.32
标普 500	2260.96	-0.44	日经 225	19427.67	-0.09
德国 DAX	11456.1	-0.11	上证综指	3139.56	0.07
法国 CAC	4834.63	0.02	深证成指	10306.92	-0.06

国内金融期货前日涨跌

	收盘价	涨跌幅%	持仓量	成交量
IF1701	3300.00	-0.14	28026	7730
IF1703	3261.00	-0.04	9505	602
TF1703	97.78	0.05	23846	24030
T1703	94.75	0.17	54753	104546

----- 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
2016-12-22	2.8718	3.0588	3.0675	3.1783	3.1908	3.5695
2016-12-21	2.9194	3.0588	3.1374	3.2499	3.2815	3.6544
2016-12-20	3.0491	3.1229	3.1906	3.2939	3.3739	3.7044
2016-12-19	3.0491	3.0498	3.1483	3.2927	3.3316	3.6832

市场资金加权平均利率

	R001. IB	R007. IB	GC001	GC007	IB0001	IB0007
2016-12-22	2.2424	2.7883	6.2360	4.4195	2.3761	3.0358
2016-12-21	2.4153	3.2765	4.0671	4.8822	2.381	2.8648
2016-12-20	2.5111	3.6443	6.2133	6.6892	2.3794	2.9698
2016-12-19	2.5171	3.6845	6.9465	5.9805	2.3747	2.7989

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)
2016-12-22	160023.IB	14.20	8.40	3.1955	-12.45
	160020.IB	17.90	5.96	3.2000	-5.50
	160210.IB	161.10	7.69	3.7013	-5.00
2016-12-21	160023.IB	10.60	8.39	3.3200	-5.00
	160020.IB	2.60	5.96	3.2550	0.50
	160210.IB	140.70	7.69	3.7513	-16.37

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