



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：2017年1月3日

姓名：黄浩

联系方式 057186774106

## 观点与策略

**股指期货：**上周大盘整体交投情绪较为清淡，市场呈现缩量震荡走势，热点相对散乱，沪指围绕 3100 点窄幅震荡。市场资金紧张程度缓解，但央行货币政策边际收紧，金融监管加强，制约资金投放力度，加剧市场对资金面压力持续加大的悲观预期。预计大盘将以低量整理为主，建议观望。

**国债期货：**上周期债价格继续反弹，但成交量大幅萎缩，持仓量进一步下滑，央行继续释放流动性缓和年末资金压力，银行间质押式回购利率保持稳定。随着资金逐步平稳和债市信任危机的结束，期债较大的贴水状态将对价格产生有力支撑，但各项长期利空因素仍将存在，期债反弹空间有限，预计期债将进入宽幅震荡，人民币汇率仍将是近期重要影响因素，央行加强外汇管制力度，期债中线仍然偏空。建议区间短空操作。



## 金融期货主要数据一览

### 全球利率

	0/N	1W	1M	3M	6M	12M
Shibor	2.2300	2.5430	3.3059	3.2726	3.2864	3.3728
Tibor	-	0.0091	0.0000	0.0573	0.1064	0.1282
Libor 美元	0.6921	0.7233	0.7717	0.9979	1.3177	1.6857
Libor 英镑	0.2188	0.2332	0.2558	0.3666	0.5330	0.7765
Libor 欧元	-0.4143	-0.3924	-0.3779	-0.3364	-0.2266	-0.0863

### 全球汇率

	2016-12-30	2016-12-29	2016-12-28	2016-12-27	2016-12-26	2016-12-23
欧元中间价	7.3068	7.2504	7.271	7.2617	7.2623	7.252
日元中间价	5.9591	5.9463	5.9179	5.9265	5.924	5.9126
美元中间价	6.937	6.9497	6.9495	6.9462	6.9459	6.9463
美元指数	102.3837	102.624	103.2914	103.0346	102.9391	102.9873
欧元兑美元	1.0517	1.0488	1.041	1.0458	1.0464	1.0457
美元兑人民币即期	6.9495	6.9547	6.9549	6.9498	6.9497	6.9494

### 各国股市概览

	收盘价	涨跌幅%		收盘价	涨跌幅%
道指	19762.6	-0.29	FTSE100	7142.83	0.32
标普 500	2238.83	-0.46	日经 225	19114.37	-0.16
德国 DAX	11481.06	0.26	上证综指	3103.64	0.24
法国 CAC	4862.31	0.49	深证成指	10177.14	0.17

### 国内金融期货前日涨跌

	收盘价	涨跌幅%	持仓量	成交量
IF1701	3285.00	-0.14	27570	8283
IF1703	3248.80	0.11	9705	582
TF1703	99.40	-0.10	14225	10257
T1703	97.32	-0.25	41239	59144

----- 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
2016-12-31	2.6503	2.7850	2.8540	2.9918	3.0115	3.4659
2016-12-30	2.6493	2.7850	2.8540	2.9918	3.0115	3.4659
2016-12-29	2.718	2.8067	2.8574	3.0120	3.0471	3.5008
2016-12-28	2.7507	2.9206	2.9274	3.0792	3.1223	3.5308

## 市场资金加权平均利率

	R001. IB	R007. IB	GC001	GC007	IB0001	IB0007
2016-12-30	2.1250	3.0140	3.2255	2.8815	2.1688	2.6805
2016-12-29	2.1680	3.5593	11.1964	3.9540	2.2264	3.3562
2016-12-28	2.1428	4.0536	13.9045	7.4659	2.2736	2.8574
2016-12-27	2.1332	3.1109	7.9088	5.6244	2.2968	2.8924

## 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)
2016-12-31	160017.IB	0.00	8.40	3.0451	0.01
	160020.IB	0.00	5.95	2.9801	0.01
	160210.IB	0.00	7.67	3.6701	0.01
2016-12-30	160017.IB	15.50	8.40	3.0450	-1.50
	160020.IB	0.00	5.95	2.9800	0.00
	160210.IB	63.10	7.68	3.6700	0.00

## 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