



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6日

姓名：黄浩

联系方式 057186774106

观点与策略

股指期货：昨日大盘窄幅震荡，沪指小幅上涨，收复 60 日均线，成交量继续放大，期指主力合约均小幅回落。大盘板块分化较为明显，军工、石化、有色等板块持续拉升。人民币出现大幅反弹，回购利率回落至前期正常水平。随着债市及汇率的企稳，市场资金面紧张状况改善，基本面预期继续向好支撑股指反弹，但资金面难以大幅宽松，本周前四个交易日持续上涨后以目前量能突破 3200 点难度较大，短线存在调整需要。建议观望。

国债期货：昨日午后期债震荡走高，市场资金保持平稳，7 天回购利率有所回落，银行间十年期国债收益率上升至 3.2%，期债表现继续强于现券，T1703 贴水幅度快速缩小至-0.3 元。基本面利空有所减弱，人民币连续大幅反弹显示出央行对汇率仍有较强控制力，但期债贴水大幅减小，基差修复行情接近尾声，预计将维持震荡。建议短空操作。



金融期货主要数据一览

全球利率

	0/N	1W	1M	3M	6M	12M
Shibor	2.1300	2.4740	3.3578	3.3384	3.3450	3.4311
Tibor	-	0.0091	0.0000	0.0573	0.1064	0.1282
Libor 美元	0.6904	0.7183	0.7656	1.0051	1.3216	1.6890
Libor 英镑	0.2250	0.2488	0.2578	0.3723	0.5356	0.7794
Libor 欧元	-0.4107	-0.3943	-0.3793	-0.3386	-0.2294	-0.0871

全球汇率

	2017-1-5	2017-1-4	2017-1-3	2016-12-30	2016-12-29	2016-12-28
欧元中间价	7.2903	7.2469	7.2772	7.3068	7.2504	7.271
日元中间价	5.9192	5.9193	5.9305	5.9591	5.9463	5.9179
美元中间价	6.9307	6.9526	6.9498	6.937	6.9497	6.9495
美元指数	101.4003	102.5107	103.2815	102.3837	102.624	103.2914
欧元兑美元	1.0605	1.049	1.0403	1.0517	1.0488	1.041
美元兑人民币即期	6.8817	6.9485	6.9557	6.9495	6.9547	6.9549

各国股市概览

	收盘价	涨跌幅%		收盘价	涨跌幅%
道指	19899.29	-0.21	FTSE100	7195.31	0.08
标普 500	2269	-0.08	日经 225	19520.69	-0.37
德国 DAX	11583.25	-0.01	上证综指	3165.41	0.21
法国 CAC	4900.4	0.03	深证成指	10371.47	-0.13

国内金融期货前日涨跌

	收盘价	涨跌幅%	持仓量	成交量
IF1701	3350.80	-0.19	27281	7689
IF1703	3308.00	-0.30	9842	760
TF1703	99.58	0.27	12818	11494
T1703	97.45	0.28	40138	67878

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
2017-1-5	2.7804	2.8567	2.9306	3.1437	3.2086	3.5970
2017-1-4	2.749	2.8599	2.9339	3.0709	3.1823	3.5677
2017-1-3	2.7484	2.8265	2.8877	3.0364	3.1054	3.5303
2016-12-31	2.6503	2.7850	2.8540	2.9918	3.0115	3.4659

市场资金加权平均利率

	R001. IB	R007. IB	GC001	GC007	IB0001	IB0007
2017-1-5	2.1009	2.4952	5.6084	3.0475	2.1932	2.4985
2017-1-4	2.1447	2.4975	4.0429	3.3485	2.2459	2.6394
2017-1-3	2.1609	2.7696	3.8297	3.5434	2.2462	2.6713
2016-12-31	2.1411	2.7125	0.0000	0.0000	2.2259	2.7308

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)
2017-1-5	160017.IB	45.40	8.36	3.2100	11.00
	160020.IB	1.60	5.93	3.1000	5.00
	160210.IB	121.21	7.64	3.7800	3.00
2017-1-4	160017.IB	0.00	8.38	3.1000	0.00
	160020.IB	11.10	5.94	3.0500	5.00
	160210.IB	124.50	7.65	3.7500	4.50

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