

金融期货晨报

期 期 : 2016 年 10 月 31 日

期 日 日 谈

如果发现自己的洞中，最重要的事就是不要再挖下去。

——沃伦·巴菲特

观点与策略

股指期货：上周股指冲高回落，周成交量略有放大。养老金入市、深港开通在即、经济工作会议来临等利好对指数具有支撑作用。沪指在 3140 点下方受阻回落至 3100 点附近，对未来经济的不确定使得市场仍缺乏信心，货币政策转型防风险，市场增量资金有限。在基本面平稳的情况下，指数转入震荡。建议观望

国债期货：上周期债深度回调后企稳，成交量显著放大，持仓回落。周五，资金面紧张程度缓解，国债收益率有所回落，但市场心态谨慎。周末，政治局会议指出注重抑制资产泡沫和防范经济金融风险，虽然人民日报发文指出货币政策并未转向，但近期资金利率、市场监管和国债收益率能够体现出货币政策由稳增长转向降杠杆。期债仍不具备趋势性行情，但短期期债价格仍将面临压力。建议中线观望，短线空单操作。

金融期货主要数据一览

全球利率

	0/N	1W	1M	3M	6M	12M
Shibor	2.2540	2.4150	2.7427	2.8221	2.8980	3.0320
Tibor	-	0.0091	0.0000	0.0573	0.1064	0.1282
Libor 美元	0.4349	0.4570	0.5343	0.8873	1.2588	1.5823
Libor 英镑	0.2281	0.2467	0.2675	0.4049	0.5669	0.8149
Libor 欧元	-0.4069	-0.3889	-0.3794	-0.3193	-0.2130	-0.0733

全球汇率

	2016-10-28	2016-10-27	2016-10-26	2016-10-25	2016-10-24	2016-10-21
欧元中间价	7.3958	7.3876	7.3707	7.364	7.3604	7.3744
日元中间价	6.4518	6.4751	6.5026	6.4922	6.5137	6.4885
美元中间价	6.7858	6.7736	6.7705	6.7744	6.769	6.7558
美元指数	98.3022	98.916	98.6148	98.7254	98.7556	98.6259
欧元兑美元	1.0985	1.0897	1.0907	1.0888	1.0873	1.0884
美元兑人民币即期	6.7795	6.7778	6.7686	6.7778	6.7718	6.7599

各国股市概览

	收盘价	涨跌幅%		收盘价	涨跌幅%
道指	18161.19	-0.047	FTSE100	6996.26	0.139
标普 500	2126.41	-0.311	日经 225	17446.41	0.634
德国 DAX	10696.19	-0.195	上证综指	3104.27	-0.260
法国 CAC	4548.58	0.331	深证成指	10711.04	-0.722

国内金融期货前日涨跌

	收盘价	涨跌幅%	持仓量	成交量
IF1611	3324.00	0.06	28027	10221
IF1612	3303.20	0.16	12523	1111
TF1612	101.89	0.02	18665	4829
T1612	101.56	0.05	35318	17340

中债国债到期收益率

	1Y	3Y	5Y	7Y	10Y	15Y
2016-10-28	2.1751	2.3397	2.4412	2.6640	2.7027	2.9933
2016-10-27	2.187	2.3489	2.4460	2.6622	2.7068	2.9953
2016-10-26	2.1803	2.3385	2.4556	2.6549	2.7200	3.0092
2016-10-25	2.1493	2.3025	2.4090	2.6110	2.6859	2.9752

市场资金加权平均利率

	R001. IB	R007. IB	GC001	GC007	IB0001	IB0007
2016-10-28	2.4346	2.9764	4.2662	3.2535	2.3238	2.676
2016-10-27	2.4595	3.2142	12.4456	4.2011	2.2953	2.9054
2016-10-26	2.4352	2.8852	5.0903	4.0592	2.3001	2.7115
2016-10-25	2.4823	2.7166	4.1042	3.4787	2.3345	2.742

活跃 CTD 券情况

		收盘价	成交量 (亿元)	修正久期 (年)	到期收益 率 (%)	收益率涨跌 (BP)
2016-10-28	160017.IB	100.38	54.70	8.37	2.6950	-2.45
	160020.IB	100.55	36.70	6.15	2.6600	0.75
	160210.IB	100.49	211.90	7.92	3.1175	1.25
2016-10-27	160017.IB	100.17	108.40	8.36	2.7195	0.45
	160020.IB	100.60	40.90	6.15	2.6525	8.26
	160210.IB	100.59	277.20	7.92	3.1050	-2.50

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 号海关大楼四楼东首	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	北京市海淀区西三环北路 89 号中国外文大厦 B 座 1104 室	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