

 **金融期货晨报**

期 期：2016年11月1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：10月收官，周一股指缩量震荡，沪指险守3100点关口。短期看，地产调控、人民币贬值利空出现后市场回调有限，此前利空因素已经被消化了。PPP、国企改革、养老金入市等积极因素继续发酵，市场继续寻找突破机会，短期仍维持震荡格局，建议观望。

国债期货：期债价格重新下跌，上周五政治局会议确定未来货币政策注重防风险抑泡沫任务，虽然人民日报强调货币政策未有转向，但市场对政策面拐点的一致判断逐渐形成。周一央行继续净投放，但市场资金利率保持前期偏高水平，银行间债券收益率继续攀升，期债无趋势性行情基础，短期进入弱震荡。建议日内空单操作。

金融期货主要数据一览

全球利率

	0/N	1W	1M	3M	6M	12M
Shibor	2.2530	2.4180	2.7453	2.8233	2.9000	3.0320
Tibor	-	0.0091	0.0000	0.0573	0.1064	0.1282
Libor 美元	0.4354	0.4598	0.5327	0.8859	1.2582	1.5823
Libor 英镑	0.2281	0.2534	0.2663	0.4049	0.5669	0.8153
Libor 欧元	-0.4069	-0.3889	-0.3794	-0.3193	-0.2130	-0.0719

全球汇率

	2016-10-31	2016-10-28	2016-10-27	2016-10-26	2016-10-25	2016-10-24
欧元中间价	7.4294	7.3958	7.3876	7.3707	7.364	7.3604
日元中间价	6.4631	6.4518	6.4751	6.5026	6.4922	6.5137
美元中间价	6.7641	6.7858	6.7736	6.7705	6.7744	6.769
美元指数	98.3517	98.3022	98.916	98.6148	98.7254	98.7556
欧元兑美元	1.0977	1.0985	1.0897	1.0907	1.0888	1.0873
美元兑人民币即期	6.7708	6.7795	6.7778	6.7686	6.7778	6.7718

各国股市概览

	收盘价	涨跌幅%		收盘价	涨跌幅%
道指	18142.42	-0.103	FTSE100	6954.22	-0.601
标普 500	2126.15	-0.012	日经 225	17425.02	-0.123
德国 DAX	10665.01	-0.292	上证综指	3100.49	-0.122
法国 CAC	4509.26	-0.864	深证成指	10704.30	-0.063

国内金融期货前日涨跌

	收盘价	涨跌幅%	持仓量	成交量
IF1611	3317.40	-0.24	27324	8789
IF1612	3293.60	-0.31	12668	928
TF1612	101.71	-0.16	17891	5950
T1612	101.25	-0.29	35094	19350

中债国债到期收益率

	1Y	3Y	5Y	7Y	10Y	15Y
2016-10-31	2.1711	2.3407	2.4518	2.6762	2.7425	3.0245
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

市场资金加权平均利率

	R001. IB	R007. IB	GC001	GC007	IB0001	IB0007
2016-10-31	2.3892	3.0659	3.9354	3.3494	2.3009	2.8098
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

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)
2016-10-31	160017.IB	100.08	71.70	8.35	2.7300	3.50
	160020.IB	100.43	137.00	6.14	2.6800	2.00
	160210.IB	100.29	247.00	7.91	3.1430	2.55
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

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