

 金融期货晨报

期 日 期：2016 年 11 月 4 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：昨日沪指增量上行，收盘站上前期高位，券商、铁路基建等板块表现强劲。外盘普遍继续下跌，市场对美国加息及大选的不确定性担忧加剧。国内股市表现相对强劲，基本面因素超预期改善提升市场信心，但在目前的严监管、资金面供给相对偏空和对明年一季度经济回调担忧的大背景下，A股短期维持箱体震荡格局。建议观望

国债期货：昨日期债继续反弹，成交量略有放大，央行 4000 亿 MLF 投放，银行间质押式回购利率继续下降，市场资金紧张程度减弱。美联储 12 月加息概率提高，人民币短期仍面临较大压力，国内流动性呈现中性偏紧状态。目前主要利空因素仍然存在，但随着资金面的缓和，市场信心有所恢复，资金面难以更加宽松，资金利率下行空间依然受限。建议中线观望，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	2.2450	2.4080	2.7490	2.8380	2.9034	3.0380
Tibor	-	0.0091	0.0000	0.0573	0.1064	0.1282
Libor 美元	0.4373	0.4603	0.5320	0.8757	1.2482	1.5651
Libor 英镑	0.2288	0.2471	0.2656	0.3994	0.5582	0.8003
Libor 欧元	-0.4071	-0.3889	-0.3803	-0.3236	-0.2151	-0.0754

全球汇率

	2016-11-3	2016-11-2	2016-11-1	2016-10-31	2016-10-28	2016-10-27
欧元中间价	7.4909	7.4713	7.428	7.4294	7.3958	7.3876
日元中间价	6.528	6.4941	6.462	6.4631	6.4518	6.4751
美元中间价	6.7491	6.7562	6.7734	6.7641	6.7858	6.7736
美元指数	97.1597	97.3731	97.735	98.3517	98.3022	98.916
欧元兑美元	1.1106	1.1096	1.1058	1.0977	1.0985	1.0897
美元兑人民币即期	6.7608	6.7613	6.7744	6.7708	6.7795	6.7778

各国股市概览

	收盘价	涨跌幅%		收盘价	涨跌幅%
道指	17930.67	-0.161	FTSE100	6790.51	-0.802
标普 500	2088.66	-0.442	日经 225	-	0.000
德国 DAX	10325.88	-0.434	上证综指	3128.94	0.845
法国 CAC	4411.68	-0.068	深证成指	10743.96	0.480

国内金融期货前日涨跌

	收盘价	涨跌幅%	持仓量	成交量
IF1611	3351.80	0.95	27804	11000
IF1612	3332.00	1.07	13648	1670
TF1612	101.91	0.11	15628	5842
T1612	101.53	0.18	29887	16213

中债国债到期收益率

	1Y	3Y	5Y	7Y	10Y	15Y
2016-11-3	2.15	2.3418	2.4421	2.6962	2.7301	3.0224
2016-11-2	2.1621	2.3515	2.4367	2.7015	2.7372	3.0290
2016-11-1	2.1741	2.3516	2.4519	2.7035	2.7375	3.0271
2016-10-31	2.1711	2.3407	2.4518	2.6762	2.7425	3.0245

市场资金加权平均利率

	R001. IB	R007. IB	GC001	GC007	IB0001	IB0007
2016-11-3	2.2230	2.4507	3.1086	2.3169	2.2881	2.6323
2016-11-2	2.3045	2.5121	2.3983	2.5991	2.2884	2.6099
2016-11-1	2.3306	2.7343	3.3527	2.9096	2.2931	2.729
2016-10-31	2.3892	3.0659	3.9354	3.3494	2.3009	2.8098

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)
2016-11-3	160017.IB	100.04	41.50	8.34	2.7350	-0.50
	160020.IB	100.36	11.20	6.13	2.6900	-0.50
	160210.IB	100.29	185.00	7.90	3.1420	0.10
2016-11-2	160017.IB	100.00	53.70	8.35	2.7400	0.25
	160020.IB	100.33	19.60	6.13	2.6950	0.50
	160210.IB	100.30	147.90	7.90	3.1410	-0.40

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