

 **金融期货晨报**

期 日 期：2016 年 11 月 7 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：**上周沪指于 3100 点上方持续震荡，近期公布的经济数据提振市场信心，但市场对房地产调控可能引发的再次放缓存在担忧。本周 10 月份宏观数据将陆续发布，市场乐观情绪缓慢增强，成交量逐渐放大。大盘有望继续震荡上行但空间相对有限且运行节奏缓慢，市场将更多以结构性机会为主，但经济压力仍然较大，货币政策更趋稳健对指数形成压力。建议观望。

**国债期货：**近期公布的各项经济数据都显示经济企稳迹象，市场对未来的预期也逐步乐观，但前期大量信贷及财政政策投放后，对经济的持续效果难以长久；随着房地产调控力度的加强，市场对明年一季度的乐观预期可能将被证伪。国债收益率不存在趋势性上升的基础，而受制于人民币汇率压力，货币政策边际趋紧，资金成本制约收益率继续下行，国债收益率将进入区间震荡。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	2.2320	2.4050	2.7489	2.8458	2.9064	3.0408
Tibor	-	0.0091	0.0000	0.0573	0.1064	0.1282
Libor 美元	0.4368	0.4595	0.5326	0.8809	1.2471	1.5601
Libor 英镑	0.2288	0.2484	0.2656	0.3990	0.5582	0.8003
Libor 欧元	-0.4064	-0.3889	-0.3803	-0.3229	-0.2166	-0.0783

## 全球汇率

	2016-11-4	2016-11-3	2016-11-2	2016-11-1	2016-10-31	2016-10-28
欧元中间价	7.4944	7.4909	7.4713	7.428	7.4294	7.3958
日元中间价	6.553	6.528	6.4941	6.462	6.4631	6.4518
美元中间价	6.7514	6.7491	6.7562	6.7734	6.7641	6.7858
美元指数	96.9016	97.1597	97.3731	97.735	98.3517	98.3022
欧元兑美元	1.1145	1.1106	1.1096	1.1058	1.0977	1.0985
美元兑人民币即期	6.7591	6.7608	6.7613	6.7744	6.7708	6.7795

## 各国股市概览

	收盘价	涨跌幅%		收盘价	涨跌幅%
道指	17888.28	-0.236	FTSE100	6693.26	-1.432
标普 500	2085.18	-0.167	日经 225	16905.36	-1.338
德国 DAX	10259.13	-0.646	上证综指	3125.32	-0.116
法国 CAC	4377.46	-0.776	深证成指	10702.57	-0.385

## 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	0.01	14651	4424
T1612	101.54	0.02	28289	10341

## 中债国债到期收益率

	1Y	3Y	5Y	7Y	10Y	15Y
2016-11-4	2.1391	2.3422	2.4524	2.7001	2.7339	3.0231
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

## 市场资金加权平均利率

	R001. IB	R007. IB	GC001	GC007	IB0001	IB0007
2016-11-4	2.1348	2.4263	2.0666	2.3264	2.2767	2.6026
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

## 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)
2016-11-4	160017.IB	100.08	43.40	8.34	2.7300	-0.50
	160020.IB	100.39	10.00	6.13	2.6850	-0.50
	160210.IB	100.38	175.90	7.90	3.1314	-1.06
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

## 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