

 **金融期货晨报**

期 期：2016 年 11 月 8 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：昨日沪指小幅上涨，黑色、有色板块表现强劲，市场分化加剧，股指在前期高点附近走势稍显谨慎。外围市场受 FBI 不起诉希拉里的影响全线大涨，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：期债震荡回落，主力合约继续移仓。银行间资金利率保持低位，但 IRS 继续上行，货币政策实质性稳健，市场对降杠杆的担忧仍存；同时商品期货大幅上涨推升通胀预期，前期价格走势与基本面的背离继续修正，市场心态已经转变。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	2.2060	2.3990	2.7489	2.8576	2.9112	3.0410
Tibor	-	0.0091	0.0000	0.0573	0.1064	0.1282
Libor 美元	0.4351	0.4584	0.5353	0.8826	1.2454	1.5590
Libor 英镑	0.2275	0.2456	0.2656	0.4064	0.5666	0.8111
Libor 欧元	-0.4071	-0.3889	-0.3803	-0.3229	-0.2137	-0.0797

全球汇率

	2016-11-7	2016-11-4	2016-11-3	2016-11-2	2016-11-1	2016-10-31
欧元中间价	7.5099	7.4944	7.4909	7.4713	7.428	7.4294
日元中间价	6.5064	6.553	6.528	6.4941	6.462	6.4631
美元中间价	6.7725	6.7514	6.7491	6.7562	6.7734	6.7641
美元指数	97.7372	96.9016	97.1597	97.3731	97.735	98.3517
欧元兑美元	1.1042	1.1145	1.1106	1.1096	1.1058	1.0977
美元兑人民币即期	6.7758	6.7591	6.7608	6.7613	6.7744	6.7708

各国股市概览

	收盘价	涨跌幅%		收盘价	涨跌幅%
道指	18259.19	2.073	FTSE100	6806.9	1.698
标普 500	2131.52	2.222	日经 225	17177.21	1.608
德国 DAX	10456.95	1.928	上证综指	3133.33	0.256
法国 CAC	4461.21	1.913	深证成指	10695.18	-0.069

国内金融期货前日涨跌

	收盘价	涨跌幅%	持仓量	成交量
IF1611	3343.40	0.06	26042	7726
IF1612	3318.80	0.00	14014	1191
TF1612	101.77	-0.13	13055	5677
T1612	101.30	-0.23	25105	12962

中债国债到期收益率

	1Y	3Y	5Y	7Y	10Y	15Y
2016-11-7	2.1451	2.3581	2.4663	2.7161	2.7475	3.0437
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

市场资金加权平均利率

	R001. IB	R007. IB	GC001	GC007	IB0001	IB0007
2016-11-7	2.1261	2.4211	2.1054	2.2805	2.2502	2.5899
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

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)
2016-11-7	160017.IB	99.89	39.60	8.33	2.7525	2.25
	160020.IB	100.21	22.30	6.12	2.7150	3.00
	160210.IB	100.24	173.80	7.89	3.1485	1.71
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

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