



金融期货晨报

日期：2016年11月11日

期谚日日谈

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：昨日沪深两市高开高走，随后在高位横盘整理，最终两市收盘涨幅均超过 1%，各板块出现普涨。美国大选尘埃落定，市场避险情绪大幅减弱，外围市场集体上涨，股市、债券、商品联动性增强。但防风险、限泡沫的政策抑制股市资金进入速度，货币政策趋向中性，资金面阶段性收缩，股指难以快速有效突破，震荡整理仍是目前行情的主基调。建议观望。

国债期货：昨日期债继续大幅下挫，十年期国债收益率攀升至 2.8%水平，美债突破标志性的 2%关口；近期各工业品价格出现同步上涨，市场预期美国大选将导致扩张性的财政政策，通胀压力迫使美联储加快加息步伐。人民币贬值压力加大，离岸盘中触及 6.83，市场对国内货币政策收缩的预期加强。近期长端收益率回升幅度较大，基本面并不支持继续快速向上，建议观望。

金融期货主要数据一览

全球利率

	0/N	1W	1M	3M	6M	12M
Shibor	2.1960	2.3930	2.7460	2.8701	2.9185	3.0440
Tibor	-	0.0091	0.0000	0.0573	0.1064	0.1282
Libor 美元	0.4323	0.4573	0.5364	0.8865	1.2427	1.5562
Libor 英镑	0.2288	0.2447	0.2609	0.4031	0.5626	0.8096
Libor 欧元	-0.4050	-0.3879	-0.3824	-0.3321	-0.2137	-0.0776

全球汇率

	2016-11-10	2016-11-9	2016-11-8	2016-11-7	2016-11-4	2016-11-3
欧元中间价	7.4165	7.4742	7.4893	7.5099	7.4944	7.4909
日元中间价	6.4245	6.46	6.49	6.5064	6.553	6.528
美元中间价	6.7885	6.7832	6.7817	6.7725	6.7514	6.7491
美元指数	98.7808	98.6637	97.873	97.7372	96.9016	97.1597
欧元兑美元	1.0893	1.0907	1.1024	1.1042	1.1145	1.1106
美元兑人民币即期	6.7925	6.7731	6.78	6.7758	6.7591	6.7608

各国股市概览

	收盘价	涨跌幅%		收盘价	涨跌幅%
道指	18808.35	1.184	FTSE100	6827.98	-1.213
标普 500	2167.48	0.195	日经 225	17344.42	6.725
德国 DAX	10630.12	-0.149	上证综指	3171.28	1.372
法国 CAC	4530.95	-0.276	深证成指	10821.66	1.164

国内金融期货前日涨跌

	收盘价	涨跌幅%	持仓量	成交量
IF1611	3379.40	1.03	24528	9322
IF1612	3356.00	1.03	16106	2446
TF1612	101.76	0.00	9956	8474
T1612	101.26	0.04	16727	18916

中债国债到期收益率

	1Y	3Y	5Y	7Y	10Y	15Y
2016-11-10	2.1401	2.3691	2.4837	2.7614	2.7926	3.0785
2016-11-9	2.1401	2.3689	2.4887	2.7359	2.7651	3.0567
2016-11-8	2.1451	2.3635	2.4733	2.7438	2.7634	3.0596
2016-11-7	2.1451	2.3581	2.4663	2.7161	2.7475	3.0437

市场资金加权平均利率

	R001. IB	R007. IB	GC001	GC007	IB0001	IB0007
2016-11-10	2.2834	2.5509	4.0263	2.4542	2.2439	2.5569
2016-11-9	2.1630	2.3975	2.0893	2.2796	2.2359	2.5592
2016-11-8	2.1453	2.3780	2.0184	2.2170	2.2425	2.605
2016-11-7	2.1261	2.4211	2.1054	2.2805	2.2502	2.5899

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)
2016-11-10	160017.IB	99.49	74.10	8.32	2.8000	3.75
	160020.IB	99.90	22.70	6.10	2.7650	4.00
	160210.IB	100.01	284.90	7.88	3.1775	3.00
2016-11-9	160017.IB	99.81	80.70	8.32	2.7625	2.00
	160020.IB	100.15	10.70	6.11	2.7250	-2.00
	160210.IB	100.25	249.20	7.88	3.1475	-0.55

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	北京市海淀区万寿路 2 号西翠宾馆 601、603 房间	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