

 **金融期货晨报**

期 期：2016 年 11 月 16 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：昨日股指窄幅波动，沪指仍站上 3200 点，沪深两市融资融券余额持续上升，投资者情绪回暖。场避险情绪较前期大幅减弱，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，股指缺乏快速拉升基础，震荡上行成为目前主要基调。建议待回调后多单介入。

国债期货：期债探底反弹，早盘十年期国债收益率上升接近 2.9% 位置，午后截至 14 时 10 分回落至 2.86%；银行间 7 天回购利率较昨日继续上升，市场资金中性偏紧。人民币面临较大贬值压力，在岸价格突破 6.86。货币政策边际收紧，债券市场继续降杠杆，期债反弹力度有限，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	2.2470	2.4150	2.7511	2.8955	2.9303	3.0490
Tibor	-	0.0091	0.0000	0.0573	0.1064	0.1282
Libor 美元	0.4334	0.4592	0.5421	0.9112	1.2749	1.6101
Libor 英镑	0.2275	0.2471	0.2644	0.3978	0.5660	0.8174
Libor 欧元	-0.4064	-0.3917	-0.3781	-0.3321	-0.2137	-0.0769

全球汇率

	2016-11-15	2016-11-14	2016-11-11	2016-11-10	2016-11-9	2016-11-8
欧元中间价	7.3676	7.3808	7.4071	7.4165	7.4742	7.4893
日元中间价	6.3424	6.3835	6.3718	6.4245	6.46	6.49
美元中间价	6.8495	6.8291	6.8115	6.7885	6.7832	6.7817
美元指数	100.1904	100.0214	98.9723	98.7808	98.6637	97.873
欧元兑美元	1.0722	1.0736	1.0856	1.0893	1.0907	1.1024
美元兑人民币即期	6.853	6.8409	6.8155	6.7925	6.7731	6.78

各国股市概览

	收盘价	涨跌幅%		收盘价	涨跌幅%
道指	18923.06	0.288	FTSE100	6792.74	0.586
标普 500	2180.39	0.748	日经 225	17668.15	-0.025
德国 DAX	10735.14	0.388	上证综指	3206.99	-0.105
法国 CAC	4536.53	0.621	深证成指	10958.10	0.464

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
TF1703	100.81	0.03	16710	9677
T1703	99.84	0.14	44058	30839

中债国债到期收益率

	1Y	3Y	5Y	7Y	10Y	15Y
2016-11-15	2.1618	2.4062	2.6023	2.8254	2.8501	3.1636
2016-11-14	2.1313	2.3656	2.5877	2.8143	2.8577	3.1486
2016-11-11	2.1406	2.3714	2.5252	2.7819	2.8150	3.0973
2016-11-10	2.1401	2.3691	2.4837	2.7614	2.7926	3.0785

市场资金加权平均利率

	R001. IB	R007. IB	GC001	GC007	IB0001	IB0007
2016-11-15	2.3330	2.7278	2.9733	2.9690	2.2773	2.5959
2016-11-14	2.3412	2.6296	2.9484	2.7482	2.2741	2.6306
2016-11-11	2.2723	2.6181	2.5147	2.5222	2.2473	2.5732
2016-11-10	2.2834	2.5509	4.0263	2.4542	2.2439	2.5569

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)
2016-11-15	160017.IB	98.99	82.20	8.29	2.8600	0.50
	160020.IB	99.57	11.10	6.09	2.8200	0.50
	160210.IB	99.66	358.60	7.86	3.2205	1.05
2016-11-14	160017.IB	99.03	85.00	8.30	2.8550	7.00
	160020.IB	99.60	12.60	6.09	2.8150	3.50
	160210.IB	99.75	289.30	7.86	3.2100	2.00

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