

 **金融期货晨报**

期 期 : 2016 年 11 月 17 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：昨日股指继续盘整，沪指尾盘守住 3200 点，市场短线波动加大，热点轮换加速。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：期债震荡下行，十年期国债收益率小幅上升，市场资金利率平稳，人民币即期汇率攀升逼近 6.88，持续贬值影响市场对货币政策的预期，市场心态短期仍然悲观。国债收益率短期快速上行，但经济基本面仍将促使利率低位运行，期债缺乏方向性，短期进入宽幅震荡。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	2.2570	2.4280	2.7545	2.9125	2.9380	3.0540
Tibor	-	0.0091	0.0000	0.0573	0.1064	0.1282
Libor 美元	0.4329	0.4589	0.5501	0.9062	1.2721	1.6046
Libor 英镑	0.2288	0.2474	0.2668	0.3978	0.5657	0.8118
Libor 欧元	-0.4100	-0.3931	-0.3796	-0.3314	-0.2137	-0.0790

全球汇率

	2016-11-16	2016-11-15	2016-11-14	2016-11-11	2016-11-10	2016-11-9
欧元中间价	7.3592	7.3676	7.3808	7.4071	7.4165	7.4742
日元中间价	6.2905	6.3424	6.3835	6.3718	6.4245	6.46
美元中间价	6.8592	6.8495	6.8291	6.8115	6.7885	6.7832
美元指数	100.3785	100.1967	100.0214	98.9723	98.7808	98.6637
欧元兑美元	1.0688	1.0719	1.0736	1.0856	1.0893	1.0907
美元兑人民币即期	6.87	6.853	6.8409	6.8155	6.7925	6.7731

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	3205.06	-0.060
法国 CAC	4536.53	0.621	深证成指	10968.08	0.091

国内金融期货前日涨跌

	收盘价	涨跌幅%	持仓量	成交量
IF1611	3423.60	0.12	11005	8703
IF1612	3398.20	0.06	28465	7022
TF1703	100.64	-0.13	17078	7650
T1703	99.61	-0.17	44902	24215

中债国债到期收益率

	1Y	3Y	5Y	7Y	10Y	15Y
2016-11-16	2.1514	2.4068	2.6181	2.8364	2.8652	3.1724
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

市场资金加权平均利率

	R001. IB	R007. IB	GC001	GC007	IB0001	IB0007
2016-11-16	2.3779	2.8551	3.0827	2.9298	2.2867	2.7312
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

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)
2016-11-16	160017.IB	98.94	63.20	8.29	2.8650	0.50
	160020.IB	99.51	9.00	6.08	2.8300	1.00
	160210.IB	99.50	319.50	7.85	3.2411	2.06
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

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