

 金融期货晨报

期 期 : 2016 年 11 月 18 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。建议观望。

国债期货：债弱勢震荡，市场资金面平稳，DR007 略有回落，十年期国债收益率上升至 2.91%。人民币仍面临较强贬值压力，临近年底中央经济工作会议，未来财政政策及货币政策基调已经明确，美债及汇率因素对期债影响加强，人民币尚不具备长期贬值趋势，经济基本面也仍支持利率低位运行，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	2.2590	2.4360	2.7608	2.9325	2.9526	3.0605
Tibor	-	0.0091	0.0000	0.0573	0.1064	0.1282
Libor 美元	0.4329	0.4570	0.5546	0.9087	1.2754	1.6118
Libor 英镑	0.2288	0.2456	0.2668	0.3984	0.5653	0.8121
Libor 欧元	-0.4093	-0.3931	-0.3796	-0.3286	-0.2166	-0.0804

全球汇率

	2016-11-17	2016-11-16	2016-11-15	2016-11-14	2016-11-11	2016-11-10
欧元中间价	7.3551	7.3592	7.3676	7.3808	7.4071	7.4165
日元中间价	6.3206	6.2905	6.3424	6.3835	6.3718	6.4245
美元中间价	6.8692	6.8592	6.8495	6.8291	6.8115	6.7885
美元指数	-	100.3785	100.1967	100.0214	98.9723	98.7808
欧元兑美元	-	1.0688	1.0719	1.0736	1.0856	1.0893
美元兑人民币即期	6.87	6.87	6.853	6.8409	6.8155	6.7925

各国股市概览

	收盘价	涨跌幅%		收盘价	涨跌幅%
道指	18903.96	0.190	FTSE100	6794.71	0.667
标普 500	2187.12	0.468	日经 225	17862.63	0.002
德国 DAX	10685.54	0.203	上证综指	3208.45	0.106
法国 CAC	4527.77	0.592	深证成指	10945.42	-0.207

国内金融期货前日涨跌

	收盘价	涨跌幅%	持仓量	成交量
IF1611	3429.60	0.14	5649	7231
IF1612	3405.80	0.11	32812	9307
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
2016-11-17	2.1813	2.4318	2.6638	2.8517	2.9055	3.2187
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

市场资金加权平均利率

	R001. IB	R007. IB	GC001	GC007	IB0001	IB0007
2016-11-17	2.3713	2.8080	5.3396	2.8265	2.2863	2.7785
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

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)
2016-11-17	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
2016-11-16	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