

 **金融期货晨报**

期 期：2016 年 11 月 22 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：昨日股票市场震荡上行，盘中突破前高，成交量略有放大，非银、石化、建筑板块表现强劲；美股五大指数同日创下历史最高纪录。经济基本面对指数形成支撑，长期慢牛格局不变；但货币政策边际收紧影响资金宽裕程度，债市流出的资金暂未进入权益市场；此外，11 月份开始，解禁市值呈现递增趋势，股指将继续呈现高位震荡走势。建议观望

国债期货：期债弱势企稳，成交量大幅萎缩，十年期国债收益率 2.89% 位置窄幅波动，市场资金平稳，人民币继续承压。随着房地产调控的持续进行，房地产出现降温；年末财政支出放缓，预计明年一季度经济仍有波动，期债价格将进入盘整。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	2.2710	2.4480	2.7894	2.9701	2.9852	3.0782
Tibor	-	0.0091	0.0000	0.0573	0.1064	0.1282
Libor 美元	0.4337	0.4598	0.5660	0.9162	1.2793	1.6207
Libor 英镑	0.2288	0.2477	0.2630	0.3984	0.5666	0.8093
Libor 欧元	-0.4100	-0.3931	-0.3810	-0.3293	-0.2180	-0.0819

全球汇率

	2016-11-21	2016-11-18	2016-11-17	2016-11-16	2016-11-15	2016-11-14
欧元中间价	7.308	7.3102	7.3551	7.3592	7.3676	7.3808
日元中间价	6.2207	6.2519	6.3206	6.2905	6.3424	6.3835
美元中间价	6.8985	6.8796	6.8692	6.8592	6.8495	6.8291
美元指数	100.8917	101.342	-	100.3785	100.1967	100.0214
欧元兑美元	1.0627	1.0587	-	1.0688	1.0719	1.0736

各国股市概览

	收盘价	涨跌幅%		收盘价	涨跌幅%
道指	18956.69	0.470	FTSE100	6777.96	0.032
标普 500	2198.18	0.746	日经 225	18106.02	0.771
德国 DAX	10685.13	0.193	上证综指	3218.15	0.792
法国 CAC	4529.58	0.560	深证成指	10899.92	0.099

国内金融期货前日涨跌

	收盘价	涨跌幅%	持仓量	成交量
IF1612	3415	0.61	36986	10971
IF1703	3344	0.63	3619	563
TF1703	100.445	0.00	19074	6374
T1703	99.535	0.04	49719	16954

中债国债到期收益率

	1Y	3Y	5Y	7Y	10Y	15Y
2016-11-21	2.2027	2.4567	2.6694	2.8566	2.8851	3.1977
2016-11-18	2.2258	2.4463	2.6582	2.8573	2.8901	3.2039
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

市场资金加权平均利率

	R001. IB	R007. IB	GC001	GC007	IB0001	IB0007
2016-11-21	2.3101	2.7126	3.0160	2.8544	2.2989	2.7209
2016-11-18	2.3355	2.7060	3.1011	2.8152	2.2958	2.5529
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

活跃 CTD 券情况

		成交量(亿元)	修正久期(年)	到期收益率(%)
2016-11-21	160017.IB	64.30	8.27	2.8850
	160020.IB	25.30	6.07	2.8500
	160210.IB	315.40	7.83	3.2704
2016-11-18	160017.IB	50.25	8.28	2.9250
	160020.IB	3.12	6.07	2.8800
	160210.IB	321.66	7.84	3.2650

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	山东省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1幢1505室	电话:0579-82983171	邮编:321001