

 **金融期货晨报**

期 期：2016 年 11 月 24

期 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：昨日股指冲高回落，沪指冲击 3250 点失败，成交量继续放大，银行板块冲高回落，带动个股纷纷跳水；美股再创历史最高纪录。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；昨日银行股的变现使得市场担忧短期资金撤退。建议观望

国债期货：期债震荡上行，成交持仓萎缩，十年期国债收益率回落至 2.85% 水平，市场企稳反弹。欧美权益市场价格继续上涨，美债收益率持续上升，通胀及对经济企稳预期使得债券价格承压。债券长期趋势已经改变，但经济基本面仍不支持收益率继续快速上升，期债转入弱势企稳。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	2.2770	2.4510	2.8089	2.9857	3.0036	3.0853
Tibor	-	0.0091	0.0000	0.0573	0.1064	0.1282
Libor 美元	0.4337	0.4581	0.5842	0.9248	1.2782	1.6279
Libor 英镑	0.2275	0.2474	0.2618	0.3984	0.5585	0.7990
Libor 欧元	-0.4100	-0.3939	-0.3810	-0.3307	-0.2194	-0.0797

全球汇率

	2016-11-23	2016-11-22	2016-11-21	2016-11-18	2016-11-17	2016-11-16
欧元中间价	7.3211	7.3198	7.308	7.3102	7.3551	7.3592
日元中间价	6.2037	6.2151	6.2207	6.2519	6.3206	6.2905
美元中间价	6.8904	6.8779	6.8985	6.8796	6.8692	6.8592
美元指数	101.6664	101.0194	100.8917	101.342	100.9524	100.3785
欧元兑美元	1.0552	1.0628	1.0627	1.0587	0	1.0688

各国股市概览

	收盘价	涨跌幅%		收盘价	涨跌幅%
道指	19083.18	0.31	FTSE100	6817.71	-0.03
标普 500	2204.72	0.08	日经 225	-	0.00
德国 DAX	10662.44	-0.48	上证综指	3241.14	-0.22
法国 CAC	4529.21	-0.42	深证成指	10973.80	-0.11

国内金融期货前日涨跌

	收盘价	涨跌幅%	持仓量	成交量
IF1612	3458.6	0.46	35692	10452
IF1703	3383.6	0.43	3853	451
TF1703	100.69	0.28	18994	9294
T1703	99.845	0.32	48998	21437

中债国债到期收益率

	1Y	3Y	5Y	7Y	10Y	15Y
2016-11-23	2.1853	2.4588	2.6491	2.8249	2.8451	3.1565
2016-11-22	2.1753	2.4587	2.6592	2.8536	2.8689	3.1859
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

市场资金加权平均利率

	R001. IB	R007. IB	GC001	GC007	IB0001	IB0007
2016-11-23	2.3077	2.6714	2.9568	2.8524	2.3049	2.6187
2016-11-22	2.3147	2.6946	2.9354	2.8198	2.3041	2.6089
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

活跃 CTD 券情况

		成交量(亿元)	修正久期(年)	到期收益率(%)
2016-11-23	160017.IB	59.80	8.27	2.8600
	160020.IB	3.80	6.07	2.8100
	160210.IB	258.30	7.84	3.2125
2016-11-22	160017.IB	47.20	8.27	2.8800
	160020.IB	4.10	6.07	2.8300
	160210.IB	301.70	7.84	3.2350

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