



依托大地 共创未来

大地期货金融晨报

Office
Application
System

金融期货晨报

日期：2016年11月29日

姓名：黄浩

联系方式 057186774106

观点与策略

股指期货：周一股指高开震荡，沪指突破 3270 点，成交量显著放大，建筑、有色、煤炭等板块涨势强劲。在人民币贬值压力增大，楼市、债市去杠杆背景下，市场资金更偏向于进入股票市场。同时企业扩大资本开支意愿逐步恢复，供给侧改革等制度红利释放，上市公司公司盈利能力持续修复，A 股市场将呈现慢牛格局。建议多单参与。

国债期货：期债弱势反弹，成交低迷，DR007 保持 2.5%左右水平，十年期国债收益率 2.85%窄幅波动，市场心态谨慎。短期缺乏更多政策面及基本面数据影响，期债维持弱势反弹，临近年底，市场预期经济工作会议更多指导性内容。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	2.2980	2.4660	2.8446	3.0113	3.0331	3.1199
Tibor	-	0.0091	0.0000	0.0573	0.1064	0.1282
Libor 美元	0.4348	0.4582	0.6059	0.9373	1.2899	1.6451
Libor 英镑	0.2288	0.2469	0.2609	0.3909	0.5560	0.7980
Libor 欧元	-0.4100	-0.3931	-0.3810	-0.3307	-0.2201	-0.0797

全球汇率

	2016-11-28	2016-11-25	2016-11-24	2016-11-23	2016-11-22	2016-11-21
欧元中间价	7.3292	7.3017	7.2817	7.3211	7.3198	7.308
日元中间价	6.1283	6.1058	6.1395	6.2037	6.2151	6.2207
美元中间价	6.9042	6.9168	6.9085	6.8904	6.8779	6.8985
美元指数	101.1817	101.4994	101.7389	101.6664	101.0194	100.8917
欧元兑美元	1.0613	1.0595	1.0555	1.0552	1.0628	1.0627
美元兑人民币即期	6.9022	6.9151	6.9189	6.8928	6.888	6.8956

各国股市概览

	收盘价	涨跌幅%		收盘价	涨跌幅%
道指	19097.9	-0.28	FTSE100	6799.47	-0.60
标普 500	2201.72	-0.53	日经 225	18356.89	-0.13
德国 DAX	10582.67	-1.09	上证综指	3277.00	0.46
法国 CAC	4510.39	-0.88	深证成指	11068.87	0.29

国内金融期货前日涨跌

	收盘价	涨跌幅%	持仓量	成交量
IF1612	3532.40	1.03	34874	9956
IF1703	3466.60	1.37	4104	578
TF1703	100.62	0.04	19309	3206
T1703	99.60	0.01	51201	13425

依托大地 共创未来

总部地址: 杭州市延安路 511 号元通大厦 12 楼 邮编: 310006 客服热线: 40088-40077

Headquarters Address: 12/F, Yuantong Mansion, 511Yan'an Road, Hangzhou P. C. 310006

中债国债到期收益率

	1Y	3Y	5Y	7Y	10Y	15Y
2016-11-28	2.22	2.5122	2.6587	2.8342	2.8502	3.1242
2016-11-25	2.2294	2.5102	2.6476	2.8530	2.8650	3.1468
2016-11-24	2.2002	2.4755	2.6383	2.8340	2.8502	3.1484
2016-11-23	2.1853	2.4588	2.6491	2.8249	2.8451	3.1565

市场资金加权平均利率

	R001. IB	R007. IB	GC001	GC007	IB0001	IB0007
2016-11-28	2.3569	2.9152	3.7601	3.3056	2.3171	2.6893
2016-11-25	2.3449	2.8790	3.4770	2.9178	2.3163	2.598
2016-11-24	2.3196	2.8405	5.4533	2.9040	2.3079	2.7392
2016-11-23	2.3077	2.6714	2.9568	2.8524	2.3049	2.6187

活跃 CTD 券情况

		成交量 (亿元)	修正久期(年)	到期收益率(%)	收益率涨跌(BP)
2016-11-28	160017.IB	33.30	8.26	2.8500	-2.00
	160020.IB	18.40	6.05	2.8300	-2.00
	160210.IB	213.50	7.82	3.2001	-2.49
2016-11-25	160017.IB	34.70	8.27	2.8700	1.00
	160020.IB	10.90	6.06	2.8500	2.00
	160210.IB	192.90	7.83	3.2250	1.50

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 号海关大楼一楼东首	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

----- 依托大地 共创未来 -----

总部地址：杭州市延安路 511 号元通大厦 12 楼 邮编：310006 客服热线：40088-40077

Headquarters Address: 12/F, Yuantong Mansion, 511Yan'an Road, Hangzhou P. C. 310006