



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12月2日

姓名：黄浩

联系方式 057186774106

观点与策略

股指期货：昨日沪深两市12月再迎开门红，沪指尾盘守住3250点，继IH主力合约近日出现升水以后，IF主力合约也在昨日出现非交割周升水，显示投资者依然看好后市。沪指周线7连阳之后，指数调整面临短线调整，近期市场资金面紧张，债券市场出现大幅下跌，商品市场也同步回落，股指面临调整压力，但在权重板块持续发力之下，指数维持偏强走势，预计短期内市场整体风格难以改变。建议观望。

国债期货：昨日期债继续重挫，成交保持高位，银行间资金紧张程度有所缓解，十年期国债收益率破3%关口，市场处于严重悲观。本轮行情为前期债市过度投机的调整，债券市场牛市结束，但目前经济基本面并不支持收益率持续向上突破，随着央行流动性投放加大，市场资金紧张状况将有缓解，但偏紧格局将维持至明年。此轮急跌后债券将进入弱势震荡，追空风险较大。建议观望为主。

金融期货主要数据一览

全球利率

	0/N	1W	1M	3M	6M	12M
Shibor	2.3250	2.5020	2.8930	3.0556	3.0771	3.1600
Tibor	-	0.0091	0.0000	0.0573	0.1064	0.1282
Libor 美元	0.4306	0.4582	0.6237	0.9342	1.2888	1.6390
Libor 英镑	0.2250	0.2512	0.2608	0.3846	0.5504	0.7924
Libor 欧元	-0.4100	-0.3939	-0.3796	-0.3250	-0.2187	-0.0797

全球汇率

	2016-12-1	2016-11-30	2016-11-29	2016-11-28	2016-11-25	2016-11-24
欧元中间价	7.3111	7.3386	7.3169	7.3292	7.3017	7.2817
日元中间价	6.0351	6.1316	6.1614	6.1283	6.1058	6.1395
美元中间价	6.8958	6.8865	6.8889	6.9042	6.9168	6.9085
美元指数	100.9476	101.5732	100.9546	101.1817	101.4994	101.7389
欧元兑美元	1.066	1.059	1.0647	1.0613	1.0595	1.0555
美元兑人民币即期	6.8949	6.887	6.8914	6.9022	6.9151	6.9189

各国股市概览

	收盘价	涨跌幅%		收盘价	涨跌幅%
道指	19191.93	0.36	FTSE100	6752.93	-0.45
标普 500	2191.08	-0.35	日经 225	18513.12	1.12
德国 DAX	10534.05	-1.00	上证综指	3273.31	0.72
法国 CAC	4560.61	-0.39	深证成指	11088.16	0.69

国内金融期货前日涨跌

	收盘价	涨跌幅%	持仓量	成交量
IF1612	3568.40	0.93	32099	11232
IF1703	3518.60	1.11	4575	917
TF1703	100.15	-0.06	20149	13434
T1703	98.86	-0.14	53308	42391

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
2016-12-1	2.327	2.6437	2.7839	2.9662	2.9893	3.2609
2016-11-30	2.301	2.6027	2.7282	2.9263	2.9502	3.2026
2016-11-29	2.2599	2.5525	2.7096	2.8900	2.8906	3.1592
2016-11-28	2.22	2.5122	2.6587	2.8342	2.8502	3.1242

市场资金加权平均利率

	R001. IB	R007. IB	GC001	GC007	IB0001	IB0007
2016-12-1	2.4263	3.2577	7.1162	3.3463	2.3617	2.9428
2016-11-30	2.5999	3.4916	6.6799	4.1446	2.3932	2.8942
2016-11-29	2.4209	3.0619	5.1035	3.9068	2.332	2.8502
2016-11-28	2.3569	2.9152	3.7601	3.3056	2.3171	2.6893

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)
2016-12-1	160017.IB	71.60	8.23	3.0000	6.00
	160020.IB	3.18	6.04	2.8693	-5.07
	160210.IB	261.70	7.80	3.3050	0.75
2016-11-30	160017.IB	78.50	8.24	2.9400	8.00
	160020.IB	7.00	6.04	2.9200	4.01
	160210.IB	282.90	7.81	3.2975	4.05

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