



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6日

姓名：黄浩

联系方式 057186774106

观点与策略

股指期货：昨日股票市场大幅低开，沪指尾盘险守 3200 点。监管层对“野蛮人”的表态使得险资举牌概念股大幅杀跌，部分绩优蓝筹股跟跌，但恐慌情绪并未在交易中继续发酵；资金面紧张局面将维持到年底，人民币贬值压力限制央行资金投放，前期蓝筹股带动指数，但中小票表现落后，市场存在调整压力。建议观望

国债期货：昨日期债尾盘急跌，十年期国债收益率突破 3%后上升势头减弱，但期货市场空头气氛浓重，期债未能寻得支撑；市场资金紧张程度有所缓解，但前期盲目加杠杆配置债券的机构仍处于降杠杆之中，利率债持续面临较大的抛盘压力。临近年末，市场资金整体保持紧张，人民币汇率限制央行流动性投放规模，但基本面并不支持国债收益率趋势性反弹，而受制于经济仍面临较大压力及结构性改革的继续，国债收益率在急速拉升后将进入区间震荡。建议继续观望



金融期货主要数据一览

全球利率

	0/N	1W	1M	3M	6M	12M
Shibor	2.3080	2.4970	2.9457	3.0889	3.1057	3.1853
Tibor	-	0.0091	0.0000	0.0573	0.1064	0.1282
Libor 美元	0.4348	0.4610	0.6467	0.9464	1.2916	1.6446
Libor 英镑	0.2250	0.2449	0.2594	0.3838	0.5485	0.7936
Libor 欧元	-0.4100	-0.3931	-0.3864	-0.3336	-0.2244	-0.0840

全球汇率

	2016-12-5	2016-12-2	2016-12-1	2016-11-30	2016-11-29	2016-11-28
欧元中间价	7.2709	7.3378	7.3111	7.3386	7.3169	7.3292
日元中间价	6.0792	6.0373	6.0351	6.1316	6.1614	6.1283
美元中间价	6.887	6.8794	6.8958	6.8865	6.8889	6.9042
美元指数	100.1328	100.6946	100.9476	101.5732	100.9546	101.1817
欧元兑美元	1.0764	1.067	1.066	1.059	1.0647	1.0613
美元兑人民币即期	6.8861	6.8818	6.8949	6.887	6.8914	6.9022

各国股市概览

	收盘价	涨跌幅%		收盘价	涨跌幅%
道指	19216.24	0.24	FTSE100	6746.83	0.24
标普 500	2204.71	0.58	日经 225	18274.99	-0.82
德国 DAX	10684.83	1.63	上证综指	3204.71	-1.21
法国 CAC	4574.3	1.00	深证成指	10784.33	-1.18

国内金融期货前日涨跌

	收盘价	涨跌幅%	持仓量	成交量
IF1612	3453.00	-2.10	29872	12081
IF1703	3396.40	-2.21	4936	1211
TF1703	99.77	-0.01	21845	10127
T1703	98.26	0.06	51047	39139

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
2016-12-5	2.3974	2.6216	2.8131	3.0222	3.0302	3.2883
2016-12-2	2.3509	2.6632	2.7892	2.9858	2.9895	3.2636
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

市场资金加权平均利率

	R001. IB	R007. IB	GC001	GC007	IB0001	IB0007
2016-12-5	2.2617	2.5537	2.9044	2.9916	2.3584	2.6822
2016-12-2	2.3261	2.7347	3.4886	3.1483	2.3798	2.6038
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

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)
2016-12-5	160017.IB	44.90	8.21	3.0500	5.50
	160020.IB	9.60	6.02	3.0300	37.47
	160210.IB	185.90	7.80	3.2726	-7.69
2016-12-2	160017.IB	65.50	8.23	2.9950	-0.50
	160020.IB	4.48	6.05	2.6553	-21.40
	160210.IB	201.10	7.79	3.3495	4.45

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