

 **金融期货晨报**

期 期 : 2016 年 1 月 5 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：**2016 年首个交易日股票市场便实盘检验熔断机制，全球股票市场均出现大幅回落，沪深两市再次罕见深跌，各板块普遍重挫，盘中军工板块有所护盘，但在市场恐慌性情绪蔓延后如杯水车薪。前期各政策利多因素短期影响的结束使得目前股票市场出现真空，不容乐观的经济数据使得市场谨慎态度增强，基本面再次成为压制市场的重棒。建议观望

**国债期货：**昨日期债继续回调，T1603 至 20 日均线受到支撑，成交持仓均有所放大，市场分歧加大。临近 12 月份金融数据公布，市场对央行新年降准给予期待，但从去年末央行表态来看，今年货币政策将更加稳健。前期国债收益率快速回落也吞噬今年下行空间，短期仍有调整需要。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	1.9950	2.3350	3.0010	3.0860	3.2000	3.3500
Tibor	-	0.1082	0.0000	0.1709	0.2573	0.2836
Libor 美元	0.2745	0.3898	0.4295	0.6127	0.8462	1.1780
Libor 英镑	0.4456	0.4741	0.5032	0.5904	0.7519	1.0703
Libor 欧元	-0.2814	-0.2636	-0.2043	-0.1279	-0.0386	0.0593

## 全球汇率

	2016-1-4	2015-12-31	2015-12-30	2015-12-29	2015-12-28	2015-12-25
欧元中间价	7.0483	7.0952	7.0894	7.1183	7.1007	7.0939
日元中间价	5.3993	5.3875	5.3842	5.3916	5.3809	5.3853
美元中间价	6.5032	6.4936	6.4895	6.4864	6.475	6.4713
美元指数	98.8466	98.7044	98.2344	98.2621	97.9719	97.8487
欧元兑美元	1.0832	1.0854	1.093	1.092	1.0969	1.0973

## 各国股市概览

	收盘价	涨跌幅%		收盘价	涨跌幅%
道指	17148.94	-1.584	FTSE100	6093.43	-2.385
标普 500	2012.66	-1.530	日经 225	18450.98	-3.062
德国 DAX	10283.44	-4.278	上证综指	3296.26	-6.864
法国 CAC	4522.45	-2.472	深证成指	11626.04	-8.203

## 国内金融期货前日涨跌

	收盘价	涨跌幅%	持仓量	成交量
IF1601	3425	-6.75	27612	12513
IF1603	3326	-7.00	5940	1367
TF1603	100.595	-0.10	23250	21582
T1603	99.865	-0.19	27095	25642

## 中债国债到期收益率

	1Y	3Y	5Y	7Y	10Y	15Y
2016-1-4	2.3479	2.5697	2.7488	2.8701	2.8710	3.1709
2015-12-31	2.2979	2.5466	2.7014	2.8361	2.8212	3.1587
2015-12-30	2.2979	2.5395	2.7014	2.8399	2.8261	3.1636
2015-12-29	2.3076	2.5153	2.6600	2.8100	2.8061	3.1604

## 市场资金加权平均利率

	R001. IB	R007. IB	GC001	GC007	IB0001	IB0007
2016-1-4	2.0724	2.4638	4.6635	3.4795	2.0632	2.5693
2015-12-31	2.1401	2.3897	4.3483	2.5075	2.0893	2.4457
2015-12-30	1.9435	2.6169	6.7508	2.8407	1.9665	2.5456
2015-12-29	1.9427	2.6637	2.9261	2.7975	1.9639	2.5220

## 活跃 CTD 券情况

		收盘价	加权平均价	涨跌幅
2016-1-4	150011.IB	101.5026	101.5291	-0.3114
	150003.IB	102.5911	0.0000	0.0000
2015-12-31	150011.IB	101.8197	101.8197	-0.1531
	150003.IB	102.5911	102.5911	-0.0397

## 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