

 **金融期货晨报**

期 期 : 2016 年 1 月 6 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：昨日股票市场低开反弹，盘中继续走弱，军工、钢铁、金融板块成为尾盘反弹主力。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和即将到来的解禁时点使得市场谨慎态度增强，首日暴跌极大打击市场人气，短期难以恢复。建议观望

国债期货：期债继续回调，T1603 于 20 日均线出现争夺，TF1603 击穿 20 日均线。市场资金利率继续上行，央行进行 1300 亿元逆回购缓解资金压力，银行间国债收益率较 12 月中旬上升达 10BP，但期债 IRR 保持负数。随着 12 月金融数据公布日期临近，市场对央行未来行动预期的分歧加大，空头主力出现价差。目前期债仍处技术性调整，以 10 年期 3% 中枢机选下方极限空间仍有 0.4 元。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	1.9980	2.3300	3.0010	3.0860	3.2000	3.3500
Tibor	-	0.1082	0.0000	0.1709	0.2573	0.2836
Libor 美元	0.3658	0.3875	0.4225	0.6117	0.8423	1.1693
Libor 英镑	0.4781	0.4850	0.5060	0.5913	0.7503	1.0690
Libor 欧元	-0.2836	-0.2679	-0.2079	-0.1286	-0.0400	0.0571

全球汇率

	2016-1-5	2016-1-4	2015-12-31	2015-12-30	2015-12-29	2015-12-28
欧元中间价	7.0569	7.0483	7.0952	7.0894	7.1183	7.1007
日元中间价	5.47	5.3993	5.3875	5.3842	5.3916	5.3809
美元中间价	6.5169	6.5032	6.4936	6.4895	6.4864	6.475
美元指数	99.3634	98.8466	98.7044	98.2344	98.2621	97.9719
欧元兑美元	1.0751	1.0832	1.0854	1.093	1.092	1.0969

各国股市概览

	收盘价	涨跌幅%		收盘价	涨跌幅%
道指	17158.66	0.057	FTSE100	6137.24	0.719
标普 500	2016.71	0.201	日经 225	18374	-0.417
德国 DAX	10310.1	0.259	上证综指	3287.71	-0.259
法国 CAC	4537.63	0.336	深证成指	11468.06	-1.359

国内金融期货前日涨跌

	收盘价	涨跌幅%	持仓量	成交量
IF1601	3408.8	-2.55	30025	18526
IF1603	3312	-2.30	6222	2083
TF1603	100.33	-0.27	23461	22416
T1603	99.595	-0.32	28281	21604

中债国债到期收益率

	1Y	3Y	5Y	7Y	10Y	15Y
2016-1-5	2.368	2.6173	2.7871	2.8999	2.8911	3.1909
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

市场资金加权平均利率

	R001. IB	R007. IB	GC001	GC007	IB0001	IB0007
2016-1-5	2.0705	2.4756	4.2715	3.3264	2.0666	2.5674
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

活跃 CTD 券情况

		收盘价	加权平均价	涨跌幅
2016-1-5	150011.IB	100.9388	101.4089	-0.5555
	150003.IB	102.4441	102.3911	-0.1433
2016-1-4	150011.IB	101.5026	101.5291	-0.3114
	150003.IB	102.5911	0	0.0000

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