

 **金融期货晨报**

»»» 日期：2016年1月11日

期谚日日谈

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：上周股票市场大幅震荡，恐慌情绪持续蔓延，周四第二次出现7%熔断，各板块全面重挫。国外主要股票市场均出现较大幅度下跌，证监会暂停熔断机制。上证指数回落至去年9月低位盘整均值，下方空间有限，短线小幅反弹可能性增加，但悲观的市场情绪仍然对市场造成较大压力，建议观望

国债期货：近期各期限国债、口行、国开等招标情况明显偏好，带动二级市场做多热情，市场短期资金利率在央行大量逆回购刺激下出现回落，显示出央行对利率把控力增强，也暗示出央行对目前阶段市场利率的指导区间。期货贴水对多头的优势明显减小，同时国债收益率临近前期低位，下行阻力较大。此外，人民币在岸和离岸市场均出现大幅贬值也成为影响国债期货的不稳定因素。维持多单操作，注意前期高位压力，关注12月份经济及金融数据。

金融期货主要数据一览

全球利率

	0/N	1W	1M	3M	6M	12M
Shibor	1.9580	2.3080	2.9990	3.0670	3.1856	3.3450
Tibor	-	0.1082	0.0000	0.1709	0.2573	0.2836
Libor 美元	0.3662	0.3849	0.4238	0.6211	0.8508	1.1551
Libor 英镑	0.4775	0.4843	0.5116	0.5894	0.7503	1.0440
Libor 欧元	-0.2843	-0.2743	-0.2136	-0.1386	-0.0529	0.0479

全球汇率

	2016-1-8	2016-1-7	2016-1-6	2016-1-5	2016-1-4	2015-12-31
欧元中间价	7.1735	7.0579	7.013	7.0569	7.0483	7.0952
日元中间价	5.5872	5.5246	5.4828	5.47	5.3993	5.3875
美元中间价	6.5636	6.5646	6.5314	6.5169	6.5032	6.4936
美元指数	98.3897	98.2844	99.2229	99.3634	98.8466	98.7044
欧元兑美元	1.0924	1.0928	1.078	1.0751	1.0832	1.0854

各国股市概览

	收盘价	涨跌幅%		收盘价	涨跌幅%
道指	16346.45	-1.015	FTSE100	5912.44	-0.699
标普 500	1922.03	-1.084	日经 225	17697.96	-0.390
德国 DAX	9849.34	-1.308	上证综指	3186.41	1.965
法国 CAC	4333.76	-1.586	深证成指	10888.91	1.195

国内金融期货前日涨跌

	收盘价	涨跌幅%	持仓量	成交量
IF1601	3309	-1.44	27917	19258
IF1603	3198	-1.85	6950	2137
TF1603	100.58	-0.03	23078	35229
T1603	99.865	-0.12	27116	34218

中债国债到期收益率

	1Y	3Y	5Y	7Y	10Y	15Y
2016-1-8	2.3634	2.5906	2.7347	2.8402	2.8362	3.1206
2016-1-7	2.37	2.6110	2.7538	2.8599	2.8511	3.1355
2016-1-6	2.369	2.6322	2.7598	2.8817	2.8861	3.1748
2016-1-5	2.368	2.6173	2.7871	2.8999	2.8911	3.1909

市场资金加权平均利率

	R001. IB	R007. IB	GC001	GC007	IB0001	IB0007
2016-1-8	1.9713	2.3744	2.0581	2.1584	2.019	2.5509
2016-1-7	1.9934	2.4344	2.3642	2.1442	2.0288	2.4688
2016-1-6	2.0072	2.5364	2.5506	2.6092	2.0395	2.5526
2016-1-5	2.0705	2.4756	4.2715	3.3264	2.0666	2.5674

活跃 CTD 券情况

		收盘价	加权平均价	涨跌幅
2016-1-8	150011.IB	101.5798	100.9369	0.1600
	150003.IB	102.3434	102.3487	0.0454
2016-1-7	150011.IB	101.4175	101.5902	-0.0415
	150003.IB	102.297	102.2988	0.0249

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