

 **金融期货晨报**

期 期：2016 年 1 月 12 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：**昨日股票市场继续大幅回落，恐慌情绪持续蔓延，各板块全面重挫。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，但目前市场缺乏题材，经济增速仍处回落通道，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：**期债窄幅震荡，成交量继续萎缩，银行间国债表现平稳，市场资金利率回落至 20 日平均水平。上周末央行公布外汇储量出现大幅下降，增加了市场对资金外流及汇率担忧。昨日人民币走强，疑为央行在离岸市场进行干预，但围绕中国疑虑仍在；股票市场仍表现较差，证券保证金余额加速流出，市场避险情绪增加。 维持短多操作。

# 金融期货主要数据一览

## 全球利率

	0/N	1W	1M	3M	6M	12M
Shibor	1.9510	2.3030	2.9980	3.0585	3.1783	3.3440
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

	2016-1-11	2016-1-8	2016-1-7	2016-1-6	2016-1-5	2016-1-4
欧元中间价	7.1936	7.1735	7.0579	7.013	7.0569	7.0483
日元中间价	5.6163	5.5872	5.5246	5.4828	5.47	5.3993
美元中间价	6.5626	6.5636	6.5646	6.5314	6.5169	6.5032
美元指数	98.8438	98.3897	98.2844	99.2229	99.3634	98.8466
欧元兑美元	1.0859	1.0924	1.0928	1.078	1.0751	1.0832

## 各国股市概览

	收盘价	涨跌幅%		收盘价	涨跌幅%
道指	16398.57	0.319	FTSE100	5871.83	-0.687
标普 500	1923.67	0.085	日经 225	-	0.000
德国 DAX	9825.07	-0.246	上证综指	3016.70	-5.326
法国 CAC	4312.74	-0.485	深证成指	10212.46	-6.212

## 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	100.79	0.02	23094	21535
T1603	100.23	0.00	28537	22898

## 中债国债到期收益率

	1Y	3Y	5Y	7Y	10Y	15Y
2016-1-11	2.3511	2.5792	2.6930	2.8249	2.8187	3.1031
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

## 市场资金加权平均利率

	R001. IB	R007. IB	GC001	GC007	IB0001	IB0007
2016-1-11	1.9660	2.4120	1.8109	2.2270	1.9979	2.5132
2016-1-8	1.9713	2.3744	2.0581	2.1584	2.0190	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

## 活跃 CTD 券情况

		收盘价	加权平均价	涨跌幅
2016-1-11	150011.IB	101.6622	100.8403	0.0811
	150003.IB	102.4286	102.4304	0.0832
2016-1-8	150011.IB	101.5798	100.9369	0.1600
	150003.IB	102.3434	102.3487	0.0454

## 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