

 **金融期货晨报**

期 期：2016 年 1 月 27 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：**昨日股票市场大幅下跌，两市成交量提升，午后大量主动卖盘涌现，沪指狂跌 6%，击穿 2800。市场信心脆弱，年初汇率及流动性的不利影响未完全消除，但昨日欧美市场低开高走，国内实质性政策陆续出台，利好因素正在逐渐积聚。建议观望。

**国债期货：**期债冲高回落，银行间国债收益率继续小幅提升。央行增量逆回购熨平流动性，但降准预期大幅降低，工作会议对 1 月信贷偏高进行警示，市场普遍预期央行政策短期将收紧。国开一级市场招标利率略低于二级市场，但认购倍数偏低，市场需求萎缩。期债短期仍有回调压力，季节性流动性紧张、汇率影响及信贷限制等对利率债价格造成压力。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	1.9970	2.3630	3.0570	3.0730	3.1235	3.2682
Tibor	-	0.1082	0.0000	0.1709	0.2573	0.2836
Libor 美元	0.3660	0.3877	0.4306	0.6213	0.8657	1.1529
Libor 英镑	0.4806	0.4850	0.5107	0.5894	0.7375	1.0119
Libor 欧元	-0.2821	-0.2686	-0.2257	-0.1657	-0.0893	0.0200

## 全球汇率

	2016-1-26	2016-1-25	2016-1-22	2016-1-21	2016-1-20	2016-1-19
欧元中间价	7.1183	7.0946	7.1216	7.1386	7.1627	7.1487
日元中间价	5.5493	5.5431	5.5778	5.6037	5.5834	5.5884
美元中间价	6.5548	6.5557	6.5572	6.5585	6.5578	6.5596
美元指数	99.0243	99.2929	99.5279	99.0836	99.0828	99.1251
欧元兑美元	1.0867	1.0849	1.0797	1.0875	1.089	1.0907

## 各国股市概览

	收盘价	涨跌幅%		收盘价	涨跌幅%
道指	16167.23	1.78	FTSE100	5911.46	0.59
标普 500	1903.63	1.41	日经 225	16708.9	-2.349
德国 DAX	9822.75	0.89	上证综指	2749.79	-6.423
法国 CAC	4356.81	1.05	深证成指	9483.55	-6.956

## 国内金融期货前日涨跌

	收盘价	涨跌幅%	持仓量	成交量
IF1602	2899	-4.69	27510	18918
IF1603	2820.2	-5.01	12576	2646
TF1603	100.56	0.04	18697	19734
T1603	99.91	0.04	23317	29566

## 中债国债到期收益率

	1Y	3Y	5Y	7Y	10Y	15Y
2016-1-26	2.311	2.6228	2.7633	2.8796	2.8616	3.1366
2016-1-25	2.3109	2.6301	2.7514	2.8796	2.8590	3.1341
2016-1-22	2.306	2.5647	2.6657	2.8144	2.7741	3.0491
2016-1-21	2.3006	2.5995	2.6714	2.8293	2.7914	3.0664

## 市场资金加权平均利率

	R001. IB	R007. IB	GC001	GC007	IB0001	IB0007
2016-1-26	2.0159	2.5471	2.7091	2.7081	2.0498	2.4945
2016-1-25	2.0155	2.5557	2.8625	2.9514	2.0423	2.5587
2016-1-22	2.1053	2.6168	3.6739	2.9166	2.1105	2.6247
2016-1-21	2.1905	2.7199	5.3994	3.3439	2.0902	2.7831

## 活跃 CTD 券情况

		收盘价	加权平均价	涨跌幅
2016-1-26	150011.IB	101.4022	100.9569	-0.1213
	150003.IB	102.4790	0.0000	0.0000
2016-1-25	150011.IB	101.5254	101.0885	-0.2018
	150003.IB	102.479	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