

 金融期货晨报

期 期：2016年2月1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：**上周末股票市场大幅反弹，上证指数重回 2700 点，各板块全面上涨。临近春节，央行持续释放大量流动性，市场资金利率总体平稳，但年前市场资金仍处观望，较为悲观的基本面预期使得市场缺乏支撑，市场处于寻底阶段，短期反弹仍面临反复。建议观望。

**国债期货：**十年期国债收益率反弹至 2.9 后重新回落 2.8% 上方。但在短端利率未降，特别是央行货币政策偏向谨慎的情况下，中长端利率下行空间有限。年末，市场资金仍然偏紧，利率债需求难以迅速回升。建议中线十债可以 2.8-2.9% 为区间操作。

# 金融期货主要数据一览

## 全球利率

	0/N	1W	1M	3M	6M	12M
Shibor	1.9890	2.3300	3.1680	3.1030	3.1225	3.2650
Tibor	-	0.1082	0.0000	0.1709	0.2573	0.2836
Libor 美元	0.3674	0.3939	0.4250	0.6126	0.8603	1.1398
Libor 英镑	0.4781	0.4853	0.5094	0.5894	0.7331	0.9971
Libor 欧元	-0.2829	-0.2714	-0.2329	-0.1807	-0.1064	0.0033

## 全球汇率

	2016-1-29	2016-1-28	2016-1-27	2016-1-26	2016-1-25	2016-1-22
欧元中间价	7.17	7.1461	7.1224	7.1183	7.0946	7.1216
日元中间价	5.5205	5.5357	5.5481	5.5493	5.5431	5.5778
美元中间价	6.5516	6.5528	6.5533	6.5548	6.5557	6.5572
美元指数	99.5558	98.5974	98.9821	99.0243	99.2929	99.5279
欧元兑美元	1.083	1.094	1.0892	1.0867	1.0849	1.0797

## 各国股市概览

	收盘价	涨跌幅%		收盘价	涨跌幅%
道指	16466.3	2.468	FTSE100	6083.79	2.563
标普 500	1940.24	2.476	日经 225	17518.3	2.798
德国 DAX	9798.11	1.644	上证综指	2737.60	3.085
法国 CAC	4417.02	2.195	深证成指	9418.20	3.695

## 国内金融期货前日涨跌

	收盘价	涨跌幅%	持仓量	成交量
IF1602	2903.8	2.17	27511	20277
IF1603	2843.2	2.52	13497	2886
TF1603	100.79	0.22	17424	14595
T1603	100.365	0.41	21253	24693

## 中债国债到期收益率

	1Y	3Y	5Y	7Y	10Y	15Y
2016-1-29	2.3214	2.6149	2.7492	2.8695	2.8419	3.1221
2016-1-28	2.3608	2.6240	2.7814	2.8973	2.8866	3.1669
2016-1-27	2.3519	2.6209	2.7994	2.9196	2.9016	3.1766
2016-1-26	2.311	2.6228	2.7633	2.8796	2.8616	3.1366

## 市场资金加权平均利率

	R001. IB	R007. IB	GC001	GC007	IB0001	IB0007
2016-1-29	2.0161	2.4203	2.4005	3.6997	2.0574	2.5539
2016-1-28	2.0141	2.5238	3.4033	2.3437	2.0662	2.5418
2016-1-27	2.0284	2.4742	2.4671	2.6212	2.0477	2.4936
2016-1-26	2.0159	2.5471	2.7091	2.7081	2.0498	2.4945

## 活跃 CTD 券情况

		收盘价	加权平均价	涨跌幅
2016-1-29	150011.IB	101.5405	101.5405	0.1380
	150003.IB	101.9886	0.0000	0.0000
2016-1-28	150011.IB	101.4006	101.3941	0.0788
	150003.IB	101.9886	101.9886	-0.2248

## 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