

 **金融期货晨报**

期 期 : 2016 年 2 月 2 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：昨日股票市场震荡回落，上证指数再次失守 2700 点，各板块不同程度下跌。临近春节，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，短期上证指数于 2700 位置反复，IF1602 于 2800-2900 区间震荡。建议观望。

国债期货：期债高开回落，银行间国债收益率未能延续前几交易日的回落走势，10 年期收益率保持在 2.84% 位置。临近春节，市场资产配置步伐趋缓，期债价格反弹至前期次高位后出现回落，市场谨慎情绪增加，静待年后央行政策走向。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	1.9870	2.4440	3.1270	3.0820	3.1188	3.2650
Tibor	-	0.1000	0.0000	0.1455	0.2218	0.2446
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

	2016-2-1	2016-1-29	2016-1-28	2016-1-27	2016-1-26	2016-1-25
欧元中间价	7.1075	7.17	7.1461	7.1224	7.1183	7.0946
日元中间价	5.4112	5.5205	5.5357	5.5481	5.5493	5.5431
美元中间价	6.5539	6.5516	6.5528	6.5533	6.5548	6.5557
美元指数	99.0258	99.5558	98.5974	98.9821	99.0243	99.2929
欧元兑美元	1.0889	1.083	1.094	1.0892	1.0867	1.0849

各国股市概览

	收盘价	涨跌幅%		收盘价	涨跌幅%
道指	16449.18	-0.104	FTSE100	6060.1	-0.389
标普 500	1939.38	-0.044	日经 225	17865.23	1.980
德国 DAX	9757.88	-0.411	上证综指	2688.85	-1.781
法国 CAC	4392.33	-0.559	深证成指	9322.01	-1.021

国内金融期货前日涨跌

	收盘价	涨跌幅%	持仓量	成交量
IF1602	2883.8	-1.19	26398	17230
IF1603	2825	-1.07	13651	2938
TF1603	100.76	-0.02	16449	13127
T1603	100.34	0.00	20192	19920

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
2016-2-1	2.0108	2.4615	2.4953	5.0545	2.0443	2.7433
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

活跃 CTD 券情况

		收盘价	加权平均价	涨跌幅
2016-2-1	150011.IB	101.6413	101.6235	0.0993
	150003.IB	102.3640	102.3609	0.3681
2016-1-29	150011.IB	101.5405	101.5405	0.1380
	150003.IB	101.9886	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