

# 金融期货晨报

日期：2016年2月16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：**昨日股票市场低开反弹，但受金融板块仍然偏弱的影响，上证指数未能翻红，各板块出现较大分化。欧洲股票市场出现大幅反弹，黄金下跌，避险情绪减弱。昨日人民币突破 6.5 位置，李克强表示经济若滑出合理区间将果断出手，一月外贸现 9.8%降幅，政策托底及偏弱的经济促使股市弱企稳。建议轻仓做多

**国债期货：**受春节期间外盘影响，昨日期债大幅高开，但银行间国债到期收益率未能保持下行。国际市场短期避险情绪减弱，欧洲股市大幅上涨。本周四地方债置换工作启动，债券供给压力与节前公开市场释放资金回笼对开始债券市场形成实质性压力，十年期国债收益率可能于 2.8%开始反弹。建议中线空单开始介入。

# 金融期货主要数据一览

## 全球利率

	0/N	1W	1M	3M	6M	12M
Shibor	1.9770	2.3000	2.9790	3.0410	3.1040	3.2500
Tibor	-	0.0864	0.0000	0.1191	0.1855	0.2055
Libor 美元	0.3708	0.3912	0.4305	0.6182	0.8579	1.1156
Libor 英镑	0.4813	0.4866	0.5088	0.5898	0.7300	0.9828
Libor 欧元	-0.2836	-0.2776	-0.2486	-0.2020	-0.1229	-0.0174

## 全球汇率

	2016-2-15	2016-2-12	2016-2-11	2016-2-10	2016-2-9	2016-2-8
欧元中间价	7.3397	-	-	-	-	-
日元中间价	5.7437	-	-	-	-	-
美元中间价	6.5118	-	-	-	-	-
美元指数	96.7358	95.9536	95.5945	95.7935	96.0238	96.7299
欧元兑美元	1.1154	1.1255	1.132	1.1292	1.1291	1.1192

## 各国股市概览

	收盘价	涨跌幅%		收盘价	涨跌幅%
道指	15973.84	-	FTSE100	5824.28	2.04
标普 500	1864.78	-	日经 225	16022.58	7.156
德国 DAX	9206.84	2.67	上证综指	2746.20	-0.626
法国 CAC	4115.25	3.01	深证成指	9668.85	-0.048

## 国内金融期货前日涨跌

	收盘价	涨跌幅%	持仓量	成交量
IF1602	2929.8	-0.64	20497	14438
IF1603	2876	-0.72	17241	5144
TF1603	101.015	0.25	13818	11754
T1603	100.7	0.40	15758	14835

## 中债国债到期收益率

	1Y	3Y	5Y	7Y	10Y	15Y
2016-2-15	2.3192	2.5774	2.6797	2.8641	2.8371	3.1055
2016-2-14	2.3018	2.5780	2.6840	2.8480	2.8221	3.0905
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

## 市场资金加权平均利率

	R001. IB	R007. IB	GC001	GC007	IB0001	IB0007
2016-2-15	1.9790	2.3902	2.3541	2.5164	2.0217	2.4545
2016-2-14	1.9487	2.2819	0.0000	0.0000	1.9964	2.4632
2016-2-6	2.2542	2.2712	0.0000	0.0000	2.2827	2.475
2016-2-5	1.9620	2.3663	2.6787	0.4358	2.0115	2.4736

## 活跃 CTD 券情况

		收盘价	加权平均价	涨跌幅
2016-2-15	150011.IB	101.7493	101.7493	0.0281
	150003.IB	102.4359	0.0000	0.0000
2016-2-14	150011.IB	101.7207	0	0.0000
	150003.IB	102.4359	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