

 金融期货晨报

期 日 期：2016 年 2 月 17 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：受国际市场影响，昨日股票市场大幅反弹，各板块普涨，上证指数重回 2800 点。昨日八部委联合下发文件，加大金融支持工业稳增长。1 月份社融数据公布，新增贷款创历史新高，显示资金需求出现企稳。未来信贷政策支持将继续加强，在防范系统性风险的前提下，资金定向支持力度将增加。但国际市场风险仍未能消除，波动在所难免，建议轻仓多单持有。

国债期货：昨日期债价格回落，银行间市场资金利率继续小幅上升，十债主力换季至 T1606 合约。1 月份金融市场数据显示，M2、社融规模均出现大幅上涨，市场资金需求回升，风险偏好持续下行的趋势有望减缓。随着外盘股票及商品大幅反弹，近期基于风险偏好下降而造成的利率债利好情绪减退。周四地方债置换开始进行，同时随着短期公开市场资金回笼和通胀数据预期企稳等因素，国债期货价格承压。建议中线空单开始介入，短线空单可部分获利了结。

金融期货主要数据一览

全球利率

	0/N	1W	1M	3M	6M	12M
Shibor	1.9740	2.2970	2.9570	3.0290	3.1000	3.2500
Tibor	-	0.0809	0.0000	0.1155	0.1809	0.2009
Libor 美元	0.0000	0.3934	0.4293	0.6182	0.8636	1.1283
Libor 英镑	0.4813	0.4869	0.5091	0.5929	0.7381	0.9990
Libor 欧元	-0.2836	-0.2771	-0.2486	-0.2013	-0.1184	-0.0114

全球汇率

	2016-2-16	2016-2-15	2016-2-12	2016-2-11	2016-2-10	2016-2-9
欧元中间价	7.2702	7.3397	-	-	-	-
日元中间价	5.6839	5.7437	-	-	-	-
美元中间价	6.513	6.5118	-	-	-	-
美元指数	96.8637	96.7358	95.9536	95.5945	95.7935	96.0238
欧元兑美元	1.1144	1.1154	1.1255	1.132	1.1292	1.1291

各国股市概览

	收盘价	涨跌幅%		收盘价	涨跌幅%
道指	16196.41	1.393	FTSE100	5862.17	0.651
标普 500	1895.58	1.652	日经 225	16054.43	0.199
德国 DAX	9135.11	-0.779	上证综指	2836.57	3.291
法国 CAC	4110.66	-0.112	深证成指	10045.37	3.894

国内金融期货前日涨跌

	收盘价	涨跌幅%	持仓量	成交量
IF1602	3016.6	2.83	17236	15217
IF1603	2962.8	2.93	20222	7769
TF1603	100.815	-0.19	11995	11391
T1603	100.36	-0.29	14627	13380

中债国债到期收益率

	1Y	3Y	5Y	7Y	10Y	15Y
2016-2-16	2.3452	2.5659	2.7089	2.8789	2.8376	3.1060
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

市场资金加权平均利率

	R001. IB	R007. IB	GC001	GC007	IB0001	IB0007
2016-2-16	1.9874	2.4434	1.9752	2.0353	2.0237	2.4243
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	2.4750

活跃 CTD 券情况

		收盘价	加权平均价	涨跌幅
2016-2-16	150011.IB	101.7079	101.7920	-0.0407
	150003.IB	102.4359	0.0000	0.0000
2016-2-15	150011.IB	101.7493	101.7493	0.0281
	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