

 金融期货晨报

日期：2016年2月18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：昨日股票市场震荡走高，各板块普涨。近期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：期债小幅震荡，银行间资金利率略有回落，国债招标情况稍优于二级市场，银行间国债收益率平稳。今日地方债置换工作开始，供给压力到来，央行节后流动性回笼对资金市场产生一定压力，国内外避险情绪减弱。预计期债仍将保持区间震荡，供给方面压力将对价格有压制作用。建议中线空单继续持有，短线空单离场。

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

	2016-2-17	2016-2-16	2016-2-15	2016-2-12	2016-2-11	2016-2-10
欧元中间价	7.2525	7.2702	7.3397	-	-	-
日元中间价	5.7014	5.6839	5.7437	-	-	-
美元中间价	6.5237	6.513	6.5118	-	-	-
美元指数	96.8524	96.8637	96.7358	95.9536	95.5945	95.7935
欧元兑美元	1.1128	1.1144	1.1154	1.1255	1.132	1.1292

各国股市概览

	收盘价	涨跌幅%		收盘价	涨跌幅%
道指	16453.83	1.589	FTSE100	6030.32	2.868
标普 500	1926.82	1.648	日经 225	15836.36	-1.358
德国 DAX	9377.21	2.650	上证综指	2867.34	1.085
法国 CAC	4233.47	2.988	深证成指	10161.77	1.159

国内金融期货前日涨跌

	收盘价	涨跌幅%	持仓量	成交量
IF1602	3045.6	0.81	12672	12780
IF1603	2987.8	0.83	24300	9533
TF1606	100.46	-0.02	19522	5705
T1606	99.78	-0.04	26349	13880

中债国债到期收益率

	1Y	3Y	5Y	7Y	10Y	15Y
2016-2-17	2.2817	2.5732	2.7144	2.8788	2.8351	3.1004
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

市场资金加权平均利率

	R001. IB	R007. IB	GC001	GC007	IB0001	IB0007
2016-2-17	1.9767	2.3854	1.9642	2.0462	2.0237	2.4243
2016-2-16	1.9874	2.4434	1.9752	2.0353	2.0217	2.4545
2016-2-15	1.9790	2.3902	2.3541	2.5164	1.9964	2.4632
2016-2-14	1.9487	2.2819	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
2016-2-17	150011.IB	101.7079	0.0000	0.0000
	150003.IB	102.4359	0.0000	0.0000
2016-2-16	150011.IB	101.7079	101.792	-0.0407
	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