

 **金融期货晨报**

日期：2016年2月19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：昨日股票市场冲高回落，未能突破 2900 点。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，建议观望。

国债期货：期债低开高走，午间媒体消息央行询量 MLF 操作，下调六个月、一年期利率，引起期债迅速拉升，央行公布每日进行公开市场操作，进一步显示其以利率为中介目标的政策。通胀数据显示 CPI 增速回升，制约央行宽松政策。昨日招标的湖北债需求较好，利率大幅低于国开。近期多空因素交织，市场分歧扩大，预计期债仍将维持震荡，关注央行下一步动作。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	1.9510	2.2850	2.8840	3.0040	3.1000	3.2500
Tibor	-	0.0673	0.0000	0.1064	0.1709	0.1936
Libor 美元	0.3700	0.3916	0.4301	0.6194	0.8666	1.1347
Libor 英镑	0.4850	0.4872	0.5079	0.5906	0.7373	0.9996
Libor 欧元	-0.2836	-0.2776	-0.2550	-0.2080	-0.1256	-0.0143

全球汇率

	2016-2-18	2016-2-17	2016-2-16	2016-2-15	2016-2-12	2016-2-11
欧元中间价	7.2578	7.2525	7.2702	7.3397	-	-
日元中间价	5.7203	5.7014	5.6839	5.7437	-	-
美元中间价	6.5152	6.5237	6.513	6.5118	-	-
美元指数	96.8293	96.8524	96.8637	96.7358	95.9536	95.5945
欧元兑美元	1.1106	1.1128	1.1144	1.1154	1.1255	1.132

各国股市概览

	收盘价	涨跌幅%		收盘价	涨跌幅%
道指	16413.43	-0.246	FTSE100	5971.95	-0.968
标普 500	1917.83	-0.467	日经 225	16196.8	2.276
德国 DAX	9463.64	0.922	上证综指	2862.89	-0.155
法国 CAC	4239.76	0.149	深证成指	10116.40	-0.447

国内金融期货前日涨跌

	收盘价	涨跌幅%	持仓量	成交量
IF1602	3050.6	0.35	7665	9069
IF1603	2981.8	0.01	29275	14347
TF1606	100.53	0.06	20777	5818
T1606	99.89	0.09	28089	19504

中债国债到期收益率

	1Y	3Y	5Y	7Y	10Y	15Y
2016-2-18	2.2718	2.5634	2.7053	2.8740	2.8351	3.1004
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

市场资金加权平均利率

	R001. IB	R007. IB	GC001	GC007	IB0001	IB0007
2016-2-18	1.9539	2.3686	2.2844	1.8843	2.0031	2.4943
2016-2-17	1.9767	2.3854	1.9642	2.0462	2.0296	2.4261
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

活跃 CTD 券情况

		收盘价	加权平均价	涨跌幅
2016-2-18	150023.IB	101.0876	101.0095	-0.0419
	150005.IB	105.9036	105.9966	0.0399
2016-2-17	150023.IB	101.13	100.9318	-0.8757
	150005.IB	105.8614	105.999	-0.1168

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