



金融期货晨报

日期：2016年2月22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：上涨股票市场持续反弹后动能衰减，上证指数未能突破 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。市场多头力量正在聚集，证监会主席替换后可能出现一波炒作。但国际市场风险仍未能消除，波动在所难免，建议短线做多。

国债期货：期债窄幅震荡，下调 MLF 利率并未明显影响到市场资金利率水平，等待央行更多动作。新年第一周央行回笼大量流动性，但市场资金利率未出现明显回升，说明市场资金较为充裕，加之外汇占款减少速度降低，央行降准可能性进一步降低。地方债供给压力增大，企稳的通胀数据及经济的不确定性是的期债仍将处于震荡。周五中国央行决定对部分银行提高存款准备金率，此举为定期考核商业银行贷款指标，非方向性操作。期债短期波动加剧，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	1.9380	2.2860	2.8390	2.9670	3.0740	3.2340
Tibor	-	0.0664	0.0000	0.1055	0.1682	0.1900
Libor 美元	0.3714	0.3920	0.4320	0.6182	0.8704	1.1420
Libor 英镑	0.4813	0.4880	0.5082	0.5909	0.7379	1.0071
Libor 欧元	-0.2843	-0.2776	-0.2557	-0.2123	-0.1241	-0.0147

全球汇率

	2016-2-19	2016-2-18	2016-2-17	2016-2-16	2016-2-15	2016-2-12
欧元中间价	7.2472	7.2578	7.2525	7.2702	7.3397	-
日元中间价	5.7669	5.7203	5.7014	5.6839	5.7437	-
美元中间价	6.5186	6.5152	6.5237	6.513	6.5118	-
美元指数	96.6038	96.8293	96.8524	96.8637	96.7358	95.9536
欧元兑美元	1.1129	1.1106	1.1128	1.1144	1.1154	1.1255

各国股市概览

	收盘价	涨跌幅%		收盘价	涨跌幅%
道指	16391.99	-0.131	FTSE100	5950.23	-0.364
标普 500	1917.78	-0.003	日经 225	15967.17	-1.418
德国 DAX	9388.05	-0.799	上证综指	2860.02	-0.100
法国 CAC	4223.04	-0.394	深证成指	10162.32	0.454

国内金融期货前日涨跌

	收盘价	涨跌幅%	持仓量	成交量
IF1603	2980.8	-0.26	33822	16554
IF1606	2825.4	-0.29	4679	480
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
2016-2-19	2.251	2.5670	2.7001	2.8665	2.8251	3.0911
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

市场资金加权平均利率

	R001. IB	R007. IB	GC001	GC007	IB0001	IB0007
2016-2-19	1.9367	2.3425	1.8716	1.9771	1.9819	2.4178
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

活跃 CTD 券情况

		收盘价	加权平均价	涨跌幅
2016-2-19	150023.IB	101.0868	101.0060	-0.0008
	150005.IB	105.9775	106.0014	0.0698
2016-2-18	150023.IB	101.0876	101.0095	-0.0419
	150005.IB	105.9036	105.9966	0.0399

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