

金融期货晨报

日期：2016年2月23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：昨日上证指数高开高走，重拾 2900 位置，成交量有所放大，权重板块表现较强。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。随着供给侧改革的深入，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，建议短线做多。

国债期货：期债跳空低开，随后窄幅震荡，成交量萎缩。近期金融数据的反弹和房地产刺激政策的出台部分改变市场对经济的悲观预期。央行提高部分银行准备金及加大公开市场操作频率等减弱了市场对降准的预期，工业品价格出现持续反弹及股票市场的企稳使得市场风险偏好略有回升。节后债市供给高峰来临，赤字率或扩大增加国债供给，期债压力大幅增加。建议中线空单持有。

金融期货主要数据一览

全球利率

	0/N	1W	1M	3M	6M	12M
Shibor	1.9340	2.2860	2.8010	2.9470	3.0560	3.2190
Tibor	-	0.0655	0.0000	0.1036	0.1664	0.1873
Libor 美元	0.3709	0.3931	0.4335	0.6182	0.8679	1.1398
Libor 英镑	0.4813	0.4880	0.5082	0.5906	0.7366	1.0046
Libor 欧元	-0.2836	-0.2776	-0.2604	-0.2134	-0.1270	-0.0161

全球汇率

	2016-2-22	2016-2-19	2016-2-18	2016-2-17	2016-2-16	2016-2-15
欧元中间价	7.2463	7.2472	7.2578	7.2525	7.2702	7.3397
日元中间价	5.783	5.7669	5.7203	5.7014	5.6839	5.7437
美元中间价	6.5165	6.5186	6.5152	6.5237	6.513	6.5118
美元指数	97.3696	96.6038	96.8293	96.8524	96.8637	96.7358
欧元兑美元	1.1028	1.1129	1.1106	1.1128	1.1144	1.1154

各国股市概览

	收盘价	涨跌幅%		收盘价	涨跌幅%
道指	16620.66	1.395	FTSE100	6037.73	1.471
标普 500	1945.5	1.445	日经 225	16111.05	0.901
德国 DAX	9573.59	1.976	上证综指	2927.18	2.348
法国 CAC	4298.7	1.792	深证成指	10370.99	2.053

国内金融期货前日涨跌

	收盘价	涨跌幅%	持仓量	成交量
IF1603	3042	1.98	35752	18228
IF1606	2870	1.51	4920	843
TF1606	100.39	-0.08	22985	8605
T1606	99.695	-0.11	29962	17570

中债国债到期收益率

	1Y	3Y	5Y	7Y	10Y	15Y
2016-2-22	2.2678	2.5507	2.6687	2.8741	2.8426	3.0925
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

市场资金加权平均利率

	R001. IB	R007. IB	GC001	GC007	IB0001	IB0007
2016-2-22	1.9521	2.3395	1.8760	2.1544	1.9824	2.469
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

活跃 CTD 券情况

		收盘价	加权平均价	涨跌幅
2016-2-22	150023.IB	100.9182	100.9841	-0.1668
	150005.IB	106.0040	106.0060	0.0250
2016-2-19	150023.IB	101.0868	101.006	-0.0008
	150005.IB	105.9775	106.0014	0.0698

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