

 金融期货晨报

期 期：2016 年 2 月 29 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：上周股票市场反弹受阻，周四上证指数失守 2800 点。股指跌穿 20 日均线，脆弱的市场信心、短期资金面略偏紧加大了市场恐慌心理。基本面来看，信贷数据回暖、人民币企稳及财政政策加大等并不支持新一轮的持续下跌，大盘大致上仍维持底部震荡格局。建议观望。

国债期货：国债期货持续震荡回落，十债成交量上升，T1606 表现明显弱于 TF1606，市场对汇率稳定及降准可能性降低的预期增强。空头在近期各利空因素影响下打破暂时多空平衡，但未来仍可能出现诸如经济企稳证伪、人民币企稳后政策重心移动和降低利率走廊上限的利多因素。空单离场，套利可 1.5:1 买 TF 卖 T。



金融期货主要数据一览

全球利率

	0/N	1W	1M	3M	6M	12M
Shibor	2.0480	2.3450	2.7850	2.8990	3.0300	3.1920
Tibor	-	0.0627	0.0000	0.0991	0.1627	0.1846
Libor 美元	0.3743	0.3941	0.4385	0.6356	0.8805	1.1602
Libor 英镑	0.4813	0.4878	0.5091	0.5903	0.7341	1.0046
Libor 欧元	-0.2843	-0.2797	-0.2657	-0.2173	-0.1293	-0.0197

全球汇率

	2016-2-26	2016-2-25	2016-2-24	2016-2-23	2016-2-22	2016-2-19
欧元中间价	7.2089	7.1924	7.1912	7.188	7.2463	7.2472
日元中间价	5.775	5.8282	5.8312	5.7794	5.783	5.7669
美元中间价	6.5338	6.5318	6.5302	6.5273	6.5165	6.5186
美元指数	98.1378	97.4384	97.5089	97.4617	97.3696	96.6038
欧元兑美元	1.0929	1.1019	1.1012	1.1017	1.1028	1.1129

各国股市概览

	收盘价	涨跌幅%		收盘价	涨跌幅%
道指	16639.97	-0.343	FTSE100	6096.01	1.384
标普 500	1948.05	-0.187	日经 225	16188.41	0.298
德国 DAX	9513.3	1.948	上证综指	2767.21	0.947
法国 CAC	4314.57	1.556	深证成指	9573.70	0.237

国内金融期货前日涨跌

	收盘价	涨跌幅%	持仓量	成交量
IF1603	2880	0.15	37572	20746
IF1606	2711	0.25	5104	929
TF1606	100.405	0.09	24774	14544
T1606	99.42	0.01	32828	28926

中债国债到期收益率

	1Y	3Y	5Y	7Y	10Y	15Y
2016-2-26	2.2764	2.5283	2.6499	2.8794	2.8551	3.1598
2016-2-25	2.2834	2.5319	2.6651	2.8796	2.8651	3.1431
2016-2-24	2.2638	2.5175	2.6498	2.8700	2.8676	3.1175
2016-2-23	2.2622	2.5679	2.6579	2.8693	2.8451	3.0950

市场资金加权平均利率

	R001. IB	R007. IB	GC001	GC007	IB0001	IB0007
2016-2-26	2.0919	2.5049	4.2351	2.8015	2.0965	2.4478
2016-2-25	2.1693	2.4716	5.5733	3.1183	2.0806	2.4547
2016-2-24	2.0159	2.4869	2.0215	2.3075	2.0064	2.4331
2016-2-23	1.9621	2.3489	1.8500	2.0926	1.9792	2.4403

活跃 CTD 券情况

		收盘价	加权平均价	涨跌幅
2016-2-26	150023.IB	100.8750	100.7840	0.0827
	150005.IB	105.8886	105.8298	-0.0057
2016-2-25	150023.IB	100.7916	100.8177	0.0415
	150005.IB	105.8946	105.8249	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