

 **金融期货晨报**

期 期：2016 年 3 月 1 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：**昨日股票市场继续下挫，上证指数失守 2700 点。虽然早盘银行股出现护盘，并在尾盘快速反弹翻红，但脆弱的市场信心、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。央行降准对股票市场信心将会产生重要影响，短线有望出现超跌企稳，建议短多操作。

**国债期货：**国债期货窄幅震荡，尾盘出现反弹，T1606 表现继续弱于 TF1606。昨晚央行降准 0.5%，超出市场预期。短期较为弱勢的期债可能出现较大幅度反弹，同时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。但此次降准释放流动性 5000-7000 亿元，考虑到本周公开市场操作继续大幅回笼，降准对流动性实际影响较为有限，更多地影响市场预期。建议多单操作



## 金融期货主要数据一览

### 全球利率

	0/N	1W	1M	3M	6M	12M
Shibor	2.0070	2.3350	2.8000	2.8990	3.0220	3.1860
Tibor	-	0.0618	0.0000	0.0991	0.1627	0.1836
Libor 美元	0.3745	0.3975	0.4385	0.6351	0.8807	1.1610
Libor 英镑	0.4813	0.4919	0.5079	0.5900	0.7329	0.9996
Libor 欧元	-0.2829	-0.2804	-0.2663	-0.2204	-0.1287	-0.0207

### 全球汇率

	2016-2-29	2016-2-26	2016-2-25	2016-2-24	2016-2-23	2016-2-22
欧元中间价	7.1533	7.2089	7.1924	7.1912	7.188	7.2463
日元中间价	5.763	5.775	5.8282	5.8312	5.7794	5.783
美元中间价	6.5452	6.5338	6.5318	6.5302	6.5273	6.5165
美元指数	98.2616	98.1378	97.4384	97.5089	97.4617	97.3696
欧元兑美元	1.0873	1.0929	1.1019	1.1012	1.1017	1.1028

### 各国股市概览

	收盘价	涨跌幅%		收盘价	涨跌幅%
道指	16516.5	-0.742	FTSE100	6097.09	0.018
标普 500	1932.23	-0.812	日经 225	16026.76	-0.999
德国 DAX	9495.4	-0.188	上证综指	2687.98	-2.863
法国 CAC	4353.55	0.903	深证成指	9097.36	-4.976

### 国内金融期货前日涨跌

	收盘价	涨跌幅%	持仓量	成交量
IF1603	2789	-3.49	38393	22702
IF1606	2631	-3.34	5329	1219
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
2016-2-29	2.2576	2.5370	2.6454	2.8670	2.8502	3.1566
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

## 市场资金加权平均利率

	R001. IB	R007. IB	GC001	GC007	IB0001	IB0007
2016-2-29	2.0272	2.5830	3.3628	2.8210	2.0466	2.5865
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

## 活跃 CTD 券情况

		收盘价	加权平均价	涨跌幅
2016-2-29	150023.IB	100.9168	100.9129	0.0414
	150005.IB	105.8846	105.8152	-0.0038
2016-2-26	150023.IB	100.875	100.784	0.0827
	150005.IB	105.8886	105.8298	-0.0057

## 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