

 **金融期货晨报**

期 期：2016年3月2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：昨日股票市场出现反弹，上证指数重回 2700 点，成交量萎缩。

各版块出现不同程度上涨，有色、房地产、非银和军工涨幅靠前。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产生重要影响，但货币政策的连贯性并未打破，并不预示宽松化的到来。建议短多操作。

国债期货：期债高开低走，T1606 大幅回落至前期低位。央行降准并未对债券市场产生明显影响，银行间国债仅小幅回落 2BP。未来可能出现更大力度的财政政策制约收益率进一步回落，同时短期公开市场仍处于大量净回笼抑制资金利率下行。 买 TF 卖 T 继续持有

金融期货主要数据一览

全球利率

	0/N	1W	1M	3M	6M	12M
Shibor	1.9680	2.3080	2.7950	2.8835	3.0100	3.1735
Tibor	-	0.0618	0.0000	0.0991	0.1627	0.1836
Libor 美元	0.3715	0.3973	0.4405	0.6331	0.8859	1.1788
Libor 英镑	0.4775	0.4878	0.5079	0.5913	0.7373	0.9946
Libor 欧元	-0.2821	-0.2806	-0.2723	-0.2229	-0.1320	-0.0226

全球汇率

	2016-3-1	2016-2-29	2016-2-26	2016-2-25	2016-2-24	2016-2-23
欧元中间价	7.1211	7.1533	7.2089	7.1924	7.1912	7.188
日元中间价	5.8208	5.763	5.775	5.8282	5.8312	5.7794
美元中间价	6.5385	6.5452	6.5338	6.5318	6.5302	6.5273
美元指数	98.3451	98.2616	98.1378	97.4384	97.5089	97.4617
欧元兑美元	1.0867	1.0873	1.0929	1.1019	1.1012	1.1017

各国股市概览

	收盘价	涨跌幅%		收盘价	涨跌幅%
道指	16865.08	2.110	FTSE100	6152.88	0.915
标普 500	1978.35	2.387	日经 225	16085.51	0.367
德国 DAX	9717.16	2.335	上证综指	2733.17	1.681
法国 CAC	4406.84	1.224	深证成指	9322.00	2.469

国内金融期货前日涨跌

	收盘价	涨跌幅%	持仓量	成交量
IF1603	2864.2	2.94	37993	23348
IF1606	2698.4	3.04	5207	1164
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
2016-3-1	2.2086	2.5295	2.6202	2.8598	2.8527	3.1480
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

市场资金加权平均利率

	R001. IB	R007. IB	GC001	GC007	IB0001	IB0007
2016-3-1	1.9864	2.4247	2.5765	2.3634	2.0255	2.5107
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

活跃 CTD 券情况

		收盘价	加权平均价	涨跌幅
2016-3-1	150023.IB	100.8327	100.8521	-0.0833
	150005.IB	105.8855	105.8178	0.0009
2016-2-29	150023.IB	100.9168	100.9129	0.0414
	150005.IB	105.8846	105.8152	-0.0038

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