



金融期货晨报

日期：2016年3月3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：昨日股票市场大幅反弹，上证指数放量逼近 2850 点，各板块出现普涨，有色、房地产、钢铁涨幅继续靠前。基本面来看，虽然近期 PMI 数据表现不尽人意，但信贷数据回暖、人民币企稳及财政政策加大等因素形成较强底部预期。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，反弹能否持续仍需关注更多经济数据。建议短多操作。

国债期货：期债继续回落，财政部两期国债中标利率低于预期但需求一般，受益于资金面较宽松，短端品种需求好于长端。目前市场基于风险偏好增强，出现缩久期的操作。降准之后的资金利率一直未继续下行，市场情绪谨慎，持观望心态的居多。维持多 TF 空 T 套利

金融期货主要数据一览

全球利率

	0/N	1W	1M	3M	6M	12M
Shibor	1.9620	2.3000	2.7380	2.8570	2.9960	3.1450
Tibor	-	0.0618	0.0000	0.0991	0.1627	0.1836
Libor 美元	0.3679	0.3928	0.4353	0.6316	0.8827	1.1790
Libor 英镑	0.4813	0.4863	0.5060	0.5884	0.7329	0.9971
Libor 欧元	-0.2836	-0.2821	-0.2779	-0.2229	-0.1320	-0.0226

全球汇率

	2016-3-2	2016-3-1	2016-2-29	2016-2-26	2016-2-25	2016-2-24
欧元中间价	7.1181	7.1211	7.1533	7.2089	7.1924	7.1912
日元中间价	5.7482	5.8208	5.763	5.775	5.8282	5.8312
美元中间价	6.549	6.5385	6.5452	6.5338	6.5318	6.5302
美元指数	98.1782	98.3451	98.2616	98.1378	97.4384	97.5089
欧元兑美元	1.0866	1.0867	1.0873	1.0929	1.1019	1.1012

各国股市概览

	收盘价	涨跌幅%		收盘价	涨跌幅%
道指	16899.32	0.203	FTSE100	6147.06	-0.095
标普 500	1986.45	0.409	日经 225	16746.55	4.110
德国 DAX	9776.62	0.612	上证综指	2849.68	4.263
法国 CAC	4424.89	0.410	深证成指	9766.37	4.767

国内金融期货前日涨跌

	收盘价	涨跌幅%	持仓量	成交量
IF1603	3009	4.77	38725	24454
IF1606	2841.2	4.78	5273	1203
TF1606	100.405	-0.11	25919	15041
T1606	99.135	-0.22	35041	27637

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
2016-3-2	2.2093	2.5058	2.6217	2.8715	2.8752	3.1528
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

活跃 CTD 券情况

		收盘价	加权平均价	涨跌幅
2016-3-2	150023.IB	100.7487	100.9497	-0.0833
	150005.IB	105.8840	105.8216	-0.0014
2016-3-1	150023.IB	100.8327	100.8521	-0.0833
	150005.IB	105.8855	105.8178	0.0009

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