

# 金融期货晨报

日期：2016年3月9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：**昨日股票市场早盘探底回升，成交量略有放大，前期表现较强的煤炭、地产等跌幅靠前。市场短期风险偏好回升，但受经济仍未有明显改观情绪，板块分化加剧，反弹至前期高位后缺乏量能配合，上方仍有压力。政策面影响短期对权重股影响较大，而以新产业为核心的中小创指数会从领导地位逐步变为被动跟随。建议多单谨慎操作。

**国债期货：**期债低开反弹，午后出现回落。银行间现券收益率小幅回落，十年期 2.94%位置。期债两主力合约持仓量减少，前期价格大幅回落后，T1606 明显贴水现券。在大幅回落的进出口数据公布及黑色品种继续大幅上涨后，市场对未来通胀回升仍保持预期。财政政策和货币政策定调后，伴随着供给压力和稳增长力度加大，债券牛市可能结束，“弹簧式”震荡将继续维持，短期偏弱，但考虑到十债 IRR 明显偏低，近期技术性反弹仍有空间。建议买 TF 卖 T 套利获利了结，关注更多经济数据的公布。

# 金融期货主要数据一览

## 全球利率

	0/N	1W	1M	3M	6M	12M
Shibor	1.9500	2.2930	2.6890	2.8140	2.9760	3.1120
Tibor	-	0.0618	0.0000	0.0991	0.1627	0.1836
Libor 美元	0.3720	0.3991	0.4405	0.6361	0.9007	1.2123
Libor 英镑	0.4813	0.4875	0.5091	0.5847	0.7391	1.0040
Libor 欧元	-0.2864	-0.2821	-0.2857	-0.2351	-0.1323	-0.0219

## 全球汇率

	2016-3-8	2016-3-7	2016-3-4	2016-3-3	2016-3-2	2016-3-1
欧元中间价	7.1689	7.1625	7.1494	7.1121	7.1181	7.1211
日元中间价	5.74	5.7221	5.7444	5.7591	5.7482	5.8208
美元中间价	6.5041	6.5113	6.5284	6.5412	6.549	6.5385
美元指数	97.1908	97.116	97.2084	97.599	98.1782	98.3451
欧元兑美元	1.1007	1.1013	1.101	1.0957	1.0866	1.0867

## 各国股市概览

	收盘价	涨跌幅%		收盘价	涨跌幅%
道指	16964.1	-0.643	FTSE100	6125.44	-0.921
标普 500	1979.26	-1.124	日经 225	16783.15	-0.758
德国 DAX	9692.82	-0.881	上证综指	2901.39	0.140
法国 CAC	4404.02	-0.861	深证成指	9732.73	0.298

## 国内金融期货前日涨跌

	收盘价	涨跌幅%	持仓量	成交量
IF1603	3075.4	0.23	35263	22774
IF1606	2903	-0.05	5651	1279
TF1606	100.235	0.12	27819	14667
T1606	98.82	0.13	34070	31416

## 中债国债到期收益率

	1Y	3Y	5Y	7Y	10Y	15Y
2016-3-8	2.187	2.5247	2.6602	2.9246	2.9352	3.1740
2016-3-7	2.1902	2.5172	2.6494	2.9126	2.9303	3.1697
2016-3-4	2.1742	2.5076	2.6277	2.8829	2.8952	3.1347
2016-3-3	2.2132	2.5118	2.6376	2.8930	2.9002	3.1579

## 市场资金加权平均利率

	R001. IB	R007. IB	GC001	GC007	IB0001	IB0007
2016-3-8	1.9800	2.3722	1.4494	1.8406	2.0097	2.4822
2016-3-7	1.9802	2.3611	1.6012	2.0153	2.0031	2.5222
2016-3-4	1.9689	2.3347	1.5509	1.9066	2.0093	2.4127
2016-3-3	1.9758	2.3450	2.4280	2.0154	2.0125	2.4140

## 活跃 CTD 券情况

		收盘价	加权平均价	涨跌幅
2016-3-8	150023.IB	100.3514	100.6623	-0.2281
	150005.IB	105.5435	105.2081	-0.1562
2016-3-7	150023.IB	100.5808	100.7761	-0.0623
	150005.IB	105.7086	105.1964	-0.0093

## 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