

 **金融期货晨报**

期 期 : 2016 年 3 月 11 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：昨日股票市场震荡走低，尾盘跳水，上证指数逼近 2800 点，成交量大幅萎缩。在仍然不佳的经济数据面前，市场信心依旧不足，预期分歧加大，在诸多政策落地前，股指恐将维持震荡。建议观望。

国债期货：期债高开震荡，午后出现拉升，成交量放大，十债明显强于五债。银行间国债收益率继续小幅回落，资金利率保持稳定，近期央行延续小规模逆回购。昨日，欧央行超预期降息并扩大 QE 规模，但随后德拉基暗示欧央行不再降息，此举对中国国债影响有待观察。建议观望。



金融期货主要数据一览

全球利率

	0/N	1W	1M	3M	6M	12M
Shibor	1.9470	2.2800	2.6780	2.8040	2.9590	3.1010
Tibor	-	0.0618	0.0000	0.0991	0.1627	0.1836
Libor 美元	0.3720	0.3949	0.4380	0.6346	0.8984	1.2090
Libor 英镑	0.4813	0.4886	0.5091	0.5869	0.7391	1.0040
Libor 欧元	-0.2864	-0.2964	-0.2900	-0.2421	-0.1373	-0.0233

全球汇率

	2016-3-10	2016-3-9	2016-3-8	2016-3-7	2016-3-4	2016-3-3
欧元中间价	7.1531	7.1612	7.1689	7.1625	7.1494	7.1121
日元中间价	5.7521	5.7843	5.74	5.7221	5.7444	5.7591
美元中间价	6.5127	6.5106	6.5041	6.5113	6.5284	6.5412
美元指数	96.1966	97.1776	97.1908	97.116	97.2084	97.599
欧元兑美元	1.1179	1.1	1.1007	1.1013	1.101	1.0957

各国股市概览

	收盘价	涨跌幅%		收盘价	涨跌幅%
道指	16995.13	-0.031	FTSE100	6036.7	-1.784
标普 500	1989.57	0.016	日经 225	16852.35	1.263
德国 DAX	9498.15	-2.313	上证综指	2804.73	-2.020
法国 CAC	4350.35	-1.701	深证成指	9390.35	-1.394

国内金融期货前日涨跌

	收盘价	涨跌幅%	持仓量	成交量
IF1603	2983	-1.24	32584	19317
IF1604	2926.2	-1.25	4856	2148
TF1606	100.57	0.13	29915	14526
T1606	99.42	0.30	35388	28185

中债国债到期收益率

	1Y	3Y	5Y	7Y	10Y	15Y
2016-3-10	2.1895	2.4843	2.6049	2.8651	2.8653	3.1415
2016-3-9	2.1864	2.5048	2.6244	2.8839	2.8928	3.1540
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

市场资金加权平均利率

	R001. IB	R007. IB	GC001	GC007	IB0001	IB0007
2016-3-10	1.9838	2.3584	1.7789	1.6394	2.015	2.4023
2016-3-9	1.9821	2.3380	1.4536	1.7092	2.0132	2.4371
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

活跃 CTD 券情况

		收盘价	加权平均价	涨跌幅
2016-3-10	150023.IB	100.8770	100.7982	0.2115
	150005.IB	105.7072	105.2759	0.0983
2016-3-9	150023.IB	100.6641	100.7162	0.3116
	150005.IB	105.6034	105.2039	0.0568

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