

 **金融期货晨报**

日期：2016年3月17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：昨日上证指数窄幅震荡，板块分化严重，银行板块护盘，中小票出现明显回落。目前市场缺乏方向性，各项政策有待落实，前两月经济数据受季节性扰动难以判断经济方向，预期分歧较大，在诸多政策落地前，股指恐将维持震荡。建议观望。

国债期货：期债震荡走高，成交量回升。央行降低 MLF 利率上限，银行间债券收益率回落，十年期国债收益率 2.84%，市场资金较为充裕。美联储维持利率不变，离岸人民币兑美元飙升逾 400 点，短期对期债形成利好，但十债已重回 100 元高位，收益率继续下行空间有限。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	1.9560	2.2820	2.6585	2.7930	2.9302	3.0900
Tibor	-	0.0618	0.0000	0.0991	0.1627	0.1836
Libor 美元	0.3753	0.4020	0.4413	0.6420	0.9123	1.2370
Libor 英镑	0.4800	0.4875	0.5079	0.5913	0.7466	1.0209
Libor 欧元	-0.2921	-0.3586	-0.3199	-0.2429	-0.1294	-0.0061

全球汇率

	2016-3-16	2016-3-15	2016-3-14	2016-3-11	2016-3-10	2016-3-9
欧元中间价	7.2331	7.2172	7.2457	7.2675	7.1531	7.1612
日元中间价	5.7581	5.717	5.707	5.745	5.7521	5.7843
美元中间价	6.5172	6.5079	6.4913	6.4905	6.5127	6.5106
美元指数	95.7504	96.6511	96.581	96.2259	96.1966	97.1776
欧元兑美元	1.1213	1.1105	1.1101	1.1147	1.1179	1.1

各国股市概览

	收盘价	涨跌幅%		收盘价	涨跌幅%
道指	17325.76	0.430	FTSE100	6175.49	0.579
标普 500	2027.22	0.560	日经 225	16974.45	-0.833
德国 DAX	9983.41	0.499	上证综指	2870.43	0.212
法国 CAC	4463	-0.215	深证成指	9469.03	-1.098

国内金融期货前日涨跌

	收盘价	涨跌幅%	持仓量	成交量
IF1603	3062	0.56	17790	17534
IF1604	2987.2	0.26	17376	10419
TF1606	100.8	0.13	29420	12508
T1606	99.985	0.29	36037	25859

中债国债到期收益率

	1Y	3Y	5Y	7Y	10Y	15Y
2016-3-16	2.1012	2.3770	2.5593	2.8017	2.8054	3.1097
2016-3-15	2.1275	2.4068	2.5839	2.8367	2.8404	3.1447
2016-3-14	2.1469	2.4440	2.5891	2.8415	2.8504	3.1547
2016-3-11	2.1612	2.4882	2.5727	2.8500	2.8453	3.1497

市场资金加权平均利率

	R001. IB	R007. IB	GC001	GC007	IB0001	IB0007
2016-3-16	1.9918	2.3909	2.1812	2.3621	1.996	2.4274
2016-3-15	1.9901	2.3731	2.3388	2.2730	2.0048	2.4395
2016-3-14	1.9907	2.3713	1.9968	1.9719	1.9993	2.4775
2016-3-11	1.9806	2.3248	1.5797	1.6630	2.0180	2.4426

活跃 CTD 券情况

		收盘价	加权平均价	涨跌幅
2016-3-16	150023.IB	101.2489	101.0933	0.2488
	150005.IB	106.1871	105.9821	0.1976
2016-3-15	150023.IB	100.9976	101.079	-0.0002
	150005.IB	105.9777	105.9483	-0.0034

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