

 **金融期货晨报**

期 期：2016 年 3 月 18 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：昨日上证指数震荡走高，重回 2900 点，中小票表现强劲，近期板块轮动明显。两会各项政策出台，需较长时间落实，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，美联储维持利率后国际股票及商品市场出现较大变化，股指恐将维持震荡。建议观望。

国债期货：期债震荡回落，银行间国债收益率短期持续回落至 2.85%后出现反弹，市场资金利率保持稳定，MLF 降息利好消化。期债保持震荡趋势，通胀预期消退导致期债大幅反弹后，十债再次触及 100 元关口，在未出现实质性利好情况下，此轮反弹仅为前期超跌修复。建议短空。



金融期货主要数据一览

全球利率

	0/N	1W	1M	3M	6M	12M
Shibor	1.9700	2.2880	2.6620	2.7910	2.9160	3.0780
Tibor	-	0.0618	0.0000	0.0991	0.1627	0.1836
Libor 美元	0.3743	0.3994	0.4399	0.6390	0.9174	1.2447
Libor 英镑	0.4800	0.4881	0.5082	0.5913	0.7479	1.0196
Libor 欧元	-0.3829	-0.3700	-0.3241	-0.2457	-0.1294	-0.0083

全球汇率

	2016-3-17	2016-3-16	2016-3-15	2016-3-14	2016-3-11	2016-3-10
欧元中间价	7.2888	7.2331	7.2172	7.2457	7.2675	7.1531
日元中间价	5.7608	5.7581	5.717	5.707	5.745	5.7521
美元中间价	6.4961	6.5172	6.5079	6.4913	6.4905	6.5127
美元指数	94.8074	95.7504	96.6511	96.581	96.2259	96.1966
欧元兑美元	1.1311	1.1213	1.1105	1.1101	1.1147	1.1179

各国股市概览

	收盘价	涨跌幅%		收盘价	涨跌幅%
道指	17481.49	0.899	FTSE100	6201.12	0.415
标普 500	2040.59	0.660	日经 225	16936.38	-0.224
德国 DAX	9892.2	-0.914	上证综指	2904.83	1.198
法国 CAC	4442.89	-0.451	深证成指	9791.85	3.409

国内金融期货前日涨跌

	收盘价	涨跌幅%	持仓量	成交量
IF1603	3123	1.77	9399	14253
IF1604	3067.8	2.33	25668	17904
TF1606	100.63	-0.14	28340	16114
T1606	99.695	-0.24	35263	27551

中债国债到期收益率

	1Y	3Y	5Y	7Y	10Y	15Y
2016-3-17	2.0788	2.3684	2.5660	2.8134	2.8154	3.1097
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

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
2016-3-17	150023.IB	101.2906	101.1923	0.0412
	150005.IB	105.9704	105.9722	-0.2041
2016-3-16	150023.IB	101.2489	101.0933	0.2488
	150005.IB	106.1871	105.9821	0.1976

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