

 **金融期货晨报**

日期：2016年3月21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：上周股票市场放量上行，上证指数重回 2950 点，中小票表现强劲，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，美联储维持利率后国际股票及商品市场出现较大变化，国内市场对政策落实效果给予较强期待，3 月份通胀预期增强。建议多单操作。

国债期货：上周期债冲高回落，十年期国债现券收益率回落至 2.84%后出现企稳，市场对通胀预期分歧加大。期债短期难以出现趋势性行情，缺乏明确的指引方向，较大概率维持震荡走势，随着两会后财政政策的落实和 6 月份美联储议息会议临近，期债价格波动将会加大。预计十年期国债收益率运行区间为 2.8%-2.95%，T1606 价格 99.1-100.1。建议短空操作

金融期货主要数据一览

全球利率

	0/N	1W	1M	3M	6M	12M
Shibor	1.9900	2.2950	2.6620	2.7930	2.9020	3.0685
Tibor	-	0.0618	0.0000	0.0991	0.1627	0.1836
Libor 美元	0.3748	0.3977	0.4321	0.6234	0.8883	1.2022
Libor 英镑	0.4800	0.4875	0.5094	0.5888	0.7488	1.0178
Libor 欧元	-0.3883	-0.3736	-0.3277	-0.2479	-0.1317	-0.0097

全球汇率

	2016-3-18	2016-3-17	2016-3-16	2016-3-15	2016-3-14	2016-3-11
欧元中间价	7.3253	7.2888	0	7.2172	7.2457	7.2675
日元中间价	5.8165	5.7608	0	5.717	5.707	5.745
美元中间价	6.4628	6.4961	0	6.5079	6.4913	6.4905
美元指数	95.0613	94.8074	95.7504	96.6511	96.581	96.2259
欧元兑美元	1.1269	1.1311	1.1213	1.1105	1.1101	1.1147

各国股市概览

	收盘价	涨跌幅%		收盘价	涨跌幅%
道指	17602.3	0.691	FTSE100	6189.64	-0.185
标普 500	2049.58	0.441	日经 225	16724.81	-1.249
德国 DAX	9950.8	0.592	上证综指	2955.15	1.732
法国 CAC	4462.51	0.442	深证成指	10126.59	3.419

国内金融期货前日涨跌

	收盘价	涨跌幅%	持仓量	成交量
IF1604	3125	1.69	31003	21475
IF1606	3048	2.69	7921	2136
TF1606	100.655	0.00	27854	9748
T1606	99.68	-0.05	36136	19213

中债国债到期收益率

	1Y	3Y	5Y	7Y	10Y	15Y
2016-3-18	2.0551	2.3443	2.5554	2.8210	2.8229	3.1069
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

市场资金加权平均利率

	R001. IB	R007. IB	GC001	GC007	IB0001	IB0007
2016-3-18	2.0809	2.5181	4.3255	2.5533	2.0585	2.438
2016-3-17	2.0220	2.4133	4.4301	2.5317	2.0233	2.4421
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

活跃 CTD 券情况

		收盘价	加权平均价	涨跌幅
2016-3-18	150023.IB	101.1221	101.1796	-0.1664
	150005.IB	105.9890	105.9713	0.0176
2016-3-17	150023.IB	101.2906	101.1923	0.0412
	150005.IB	105.9704	105.9722	-0.2041

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