



金融期货晨报

日期：2016年3月29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：昨日股票市场午后出现跳水，成交量有所放大。基本面缺乏实质性支撑，板块轮动较快，缺乏主线。市场对3月份通胀预期增强，股票市场资金流入缓慢加速，杠杆有抬升迹象。近期国际市场出现的不稳定因素使得主要商品价格出现反复，影响到市场经济预期。工业企业利润增速创一年新高，企业库存去化加快，政策效果显现，但上年同期基数较低，经济企稳仍需较长时间。建议谨慎做多。

国债期货：期债低开震荡，银行间国债收益率继续上升，活跃国开债150218收益率上升至近3.3%水平。周末工业企业利润数据对市场预期产生较强影响，同时临近月末，通胀预期的关注度增强。随着T1606IRR持续回升，前期基差修复为主的反弹结束，目前焦点至通胀及经济能否出现缓慢企稳迹象。建议空单继续持有



金融期货主要数据一览

全球利率

	0/N	1W	1M	3M	6M	12M
Shibor	1.9920	2.3010	2.7060	2.7970	2.8680	3.0550
Tibor	-	0.0609	0.0000	0.0991	0.1627	0.1836
Libor 美元	0.3745	0.3936	0.4350	0.6286	0.9109	1.2312
Libor 英镑	0.4800	0.4878	0.5107	0.5881	0.7404	1.0115
Libor 欧元	-0.3919	-0.3743	-0.3299	-0.2489	-0.1393	-0.0171

全球汇率

	2016-3-28	2016-3-25	2016-3-24	2016-3-23	2016-3-22	2016-3-21
欧元中间价	7.275	7.2785	7.2742	7.2834	7.2955	7.3072
日元中间价	5.7476	5.7727	5.7923	5.7853	5.7963	5.8182
美元中间价	6.5232	6.5223	6.515	6.4936	6.4971	6.4824
美元指数	95.9617	96.2626	96.1199	96.0527	95.6661	95.4094
欧元兑美元	1.1196	1.1163	1.1178	1.1179	1.1214	1.1238

各国股市概览

	收盘价	涨跌幅%		收盘价	涨跌幅%
道指	17535.39	0.112	FTSE100	6106.48	-1.494
标普 500	2037.05	0.055	日经 225	17134.37	0.774
德国 DAX	9851.35	-1.712	上证综指	2957.82	-0.725
法国 CAC	4329.68	-2.132	深证成指	10276.84	-0.608

国内金融期货前日涨跌

	收盘价	涨跌幅%	持仓量	成交量
IF1604	3129.8	-0.87	34930	18261
IF1606	3044	-0.79	8043	1589
TF1606	100.71	-0.05	28630	9042
T1606	99.615	-0.21	35896	16988

中债国债到期收益率

	1Y	3Y	5Y	7Y	10Y	15Y
2016-3-28	2.0918	2.3232	2.5339	2.8165	2.8665	3.0998
2016-3-25	2.053	2.3056	2.5181	2.7909	2.8311	3.0921
2016-3-24	2.069	2.3134	2.5298	2.8032	2.8309	3.0997
2016-3-23	2.0589	2.3351	2.5489	2.8084	2.8307	3.0997

市场资金加权平均利率

	R001. IB	R007. IB	GC001	GC007	IB0001	IB0007
2016-3-28	2.0374	2.5241	2.7965	2.9398	2.0562	2.4871
2016-3-25	2.0172	2.4468	2.8155	2.7106	2.0498	2.3450
2016-3-24	2.0268	2.4493	3.7574	2.5060	2.0534	2.398
2016-3-23	2.0522	2.5701	2.6717	2.4690	2.0719	2.4301

活跃 CTD 券情况

		收盘价	加权平均价	涨跌幅
2016-3-28	150023.IB	100.7532	100.9128	-0.1571
	150005.IB	105.8412	105.7909	0.0494
2016-3-25	150023.IB	100.9117	101.0721	-0.1245
	150005.IB	105.7889	105.7969	-0.1706

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