

 金融期货晨报

期 期 : 2016 年 4 月 1 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：**昨日股票市场窄幅震荡，沪指收盘仍位于 3000 点上方。但基本面缺乏实质性支撑，市场热点散乱，缺乏主线。近期市场资金面出现紧平衡状态，季末资金面压力制约股票市场做多热情，存量博弈制约反弹高度。美联储鸽派声音提振国际市场。此轮回调后全线反弹，基本面企稳的预期增强，但短期缺乏带动人气的热点。建议谨慎做多。

**国债期货：**期债震荡回落，五债表现明显弱于十债，前期基差修复至较合理价位。近期受季末、MPA 及货币持续净回笼压力，市场资金面趋紧，银行间 7 天回购利率已超过 1 年期国债收益率。虽然目前十债仍保持活跃合约 IRR -3% 水平，但未来随着债务供应量增大、通胀预期企稳和短端利率制约，期债价格压力加大。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	2.0170	2.3250	2.8070	2.8248	2.8700	3.0510
Tibor	-	0.0609	0.0000	0.0991	0.1627	0.1836
Libor 美元	0.3772	0.3969	0.4340	0.6251	0.8989	1.2142
Libor 英镑	0.4825	0.4871	0.5116	0.5869	0.7385	1.0034
Libor 欧元	-0.3890	-0.3743	-0.3271	-0.2490	-0.1366	-0.0159

## 全球汇率

	2016-3-31	2016-3-30	2016-3-29	2016-3-28	2016-3-25	2016-3-24
欧元中间价	7.3312	7.3327	7.2877	7.275	7.2785	7.2742
日元中间价	5.753	5.7624	5.7386	5.7476	5.7727	5.7923
美元中间价	6.4612	6.4841	6.506	6.5232	6.5223	6.515
美元指数	94.6281	94.8412	95.177	95.9617	96.2626	96.1199
欧元兑美元	1.138	1.1332	1.1289	1.1196	1.1163	1.1178

## 各国股市概览

	收盘价	涨跌幅%		收盘价	涨跌幅%
道指	17685.09	-0.178	FTSE100	6174.9	-0.456
标普 500	2059.74	-0.204	日经 225	16758.67	-0.713
德国 DAX	9965.51	-0.807	上证综指	3003.92	0.109
法国 CAC	4385.06	-1.336	深证成指	10455.37	0.093

## 国内金融期货前日涨跌

	收盘价	涨跌幅%	持仓量	成交量
IF1604	3191	0.18	34448	18153
IF1606	3088.6	0.10	7768	1110
TF1606	101.01	-0.06	31278	16357
T1606	99.8	0.01	35845	16736

## 中债国债到期收益率

	1Y	3Y	5Y	7Y	10Y	15Y
2016-3-31	2.0861	2.3025	2.4720	2.7823	2.8419	3.0713
2016-3-30	2.0796	2.3079	2.4718	2.7917	2.8362	3.0694
2016-3-29	2.1039	2.2964	2.5153	2.8113	2.8510	3.0843
2016-3-28	2.0918	2.3232	2.5339	2.8165	2.8665	3.0998

## 市场资金加权平均利率

	R001. IB	R007. IB	GC001	GC007	IB0001	IB0007
2016-3-31	2.2027	2.8519	9.2639	3.1923	2.1019	2.5751
2016-3-30	2.0951	2.7877	4.3373	3.1687	2.0752	2.4175
2016-3-29	2.0721	2.5152	3.1253	2.8876	2.0603	2.4573
2016-3-28	2.0374	2.5241	2.7965	2.9398	2.0562	2.4871

## 活跃 CTD 券情况

		收盘价	加权平均价	涨跌幅
2016-3-31	150023.IB	101.0361	100.9921	0.0412
	150005.IB	105.7893	105.7396	-0.2016
2016-3-30	150023.IB	100.9945	100.9655	0.2065
	150005.IB	106.003	105.8515	0.1491

## 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