

 **金融期货晨报**

期日 期：2016 年 4 月 6 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：股票市场涨幅扩大，中小票表现强于大盘股，市场成交量放大。

随着 3 月经济数据公布的临近，通胀预期持续提升，市场对经济缓慢企稳给予期待。虽然银行坏账、房地产地区分化和快速扩张的整体债务都隐含着风险，但仍未发现出现系统性风险的趋势。经济的不确定性、复杂的国际环境、各国不一致的货币政策和热点板块的缺失使得股票市场在一段时间内存在分歧，二季度可能维持震荡趋势。建议谨慎做多。

国债期货：期债震荡回落，成交量保持低位，市场资金利率略有回落。十年期国债收益率小幅回升约 2BP，发改委发文判断中国 CPI 会在 2016 年保持温和上涨态势，涨幅将略高于去年，此次表态对债市预期造成偏悲观影响，但目前期债仍缺乏方向性，通胀能否持续仍存分歧。建议空单谨慎持有

金融期货主要数据一览

全球利率

	0/N	1W	1M	3M	6M	12M
Shibor	1.9930	2.3020	2.8212	2.8460	2.8780	3.0500
Tibor	-	0.0609	0.0000	0.0991	0.1627	0.1836
Libor 美元	0.3794	0.3960	0.4402	0.6301	0.9041	1.2215
Libor 英镑	0.4825	0.4872	0.5088	0.5875	0.7401	1.0021
Libor 欧元	-0.3904	-0.3743	-0.3321	-0.2511	-0.1360	-0.0153

全球汇率

	2016-4-5	2016-4-4	2016-4-1	2016-3-31	2016-3-30	2016-3-29
欧元中间价	7.3665	-	7.3493	7.3312	7.3327	7.2877
日元中间价	5.8203	-	5.7413	5.753	5.7624	5.7386
美元中间价	6.4663	-	6.4585	6.4612	6.4841	6.506
美元指数	94.6133	94.5767	94.5626	94.6281	94.8412	95.177
欧元兑美元	1.1382	1.139	1.1396	1.138	1.1332	1.1289

各国股市概览

	收盘价	涨跌幅%		收盘价	涨跌幅%
道指	17603.32	-0.754	FTSE100	6091.23	-1.192
标普 500	2045.17	-1.014	日经 225	15732.82	-2.422
德国 DAX	9563.36	-2.634	上证综指	3053.07	1.447
法国 CAC	4250.28	-2.185	深证成指	10640.27	2.511

国内金融期货前日涨跌

	收盘价	涨跌幅%	持仓量	成交量
IF1604	3236.2	1.47	35953	19764
IF1606	3139.6	1.60	7759	1343
TF1606	100.875	-0.21	30581	11490
T1606	99.63	-0.25	36082	14463

中债国债到期收益率

	1Y	3Y	5Y	7Y	10Y	15Y
2016-4-5	2.0854	2.3211	2.4876	2.7794	2.8637	3.0928
2016-4-1	2.0964	2.3083	2.4716	2.7777	2.8422	3.0713
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

市场资金加权平均利率

	R001. IB	R007. IB	GC001	GC007	IB0001	IB0007
2016-4-5	2.0048	2.4193	2.6210	2.5039	2.0637	2.48
2016-4-1	2.0100	2.4369	2.7627	2.1293	2.0641	2.4421
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

活跃 CTD 券情况

		收盘价	加权平均价	涨跌幅
2016-4-5	150023.IB	100.8687	100.9537	-0.2060
	150005.IB	105.9923	105.7663	0.2243
2016-4-1	150023.IB	101.0769	100.9965	0.0404
	150005.IB	105.7551	105.7497	-0.0323

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