

 **金融期货晨报**

期 期：2016年4月7日

期 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：昨日上证指数于3000点上方窄幅震荡，石油板块维持强势。供给侧改革逐步落实，通胀预期持续提升，市场对经济缓慢企稳给予期待。债转股对金融体系系统性风险的控制及持续的去除过剩产能使得市场对经济转型充满期待。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，近期可能维持震荡趋势，各板块保持轮动。建议谨慎做多。

国债期货：期债继续震荡回落，银行间现券长短收益率继续走高，中短端较为稳定，长短端期现利差继续扩大，市场资金利率略有回落。市场对通胀预期增强，通胀及经济能否保持企稳分歧仍然存在。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 | 1.9830 | 2.2940 | 2.8068 | 2.8450 | 2.8805 | 3.0490 |
| Tibor | - | 0.0609 | 0.0000 | 0.0991 | 0.1627 | 0.1836 |
| Libor 美元 | 0.3777 | 0.3958 | 0.4385 | 0.6266 | 0.8919 | 1.2053 |
| Libor 英镑 | 0.4825 | 0.4872 | 0.5101 | 0.5894 | 0.7408 | 0.9996 |
| Libor 欧元 | -0.3904 | -0.3743 | -0.3336 | -0.2514 | -0.1360 | -0.0176 |

全球汇率

| | 2016-4-6 | 2016-4-5 | 2016-4-4 | 2016-4-1 | 2016-3-31 | 2016-3-30 |
|-------|----------|----------|----------|----------|-----------|-----------|
| 欧元中间价 | 7.367 | 7.3665 | - | 7.3493 | 7.3312 | 7.3327 |
| 日元中间价 | 5.8655 | 5.8203 | - | 5.7413 | 5.753 | 5.7624 |
| 美元中间价 | 6.4754 | 6.4663 | - | 6.4585 | 6.4612 | 6.4841 |
| 美元指数 | 94.3598 | 94.6133 | 94.5767 | 94.5626 | 94.6281 | 94.8412 |
| 欧元兑美元 | 1.1413 | 1.1382 | 1.139 | 1.1396 | 1.138 | 1.1332 |

各国股市概览

| | 收盘价 | 涨跌幅% | | 收盘价 | 涨跌幅% |
|--------|----------|-------|---------|----------|--------|
| 道指 | 17716.05 | 0.640 | FTSE100 | 6161.63 | 1.156 |
| 标普 500 | 2066.66 | 1.051 | 日经 225 | 15715.36 | -0.111 |
| 德国 DAX | 9624.51 | 0.639 | 上证综指 | 3050.59 | -0.081 |
| 法国 CAC | 4284.64 | 0.808 | 深证成指 | 10683.86 | 0.410 |

国内金融期货前日涨跌

| | 收盘价 | 涨跌幅% | 持仓量 | 成交量 |
|--------|---------|-------|-------|-------|
| IF1604 | 3239.4 | -0.13 | 35149 | 14521 |
| IF1606 | 3139 | -0.26 | 7852 | 1100 |
| 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 |
|-----------|--------|--------|--------|--------|--------|--------|
| 2016-4-6 | 2.1057 | 2.3466 | 2.4964 | 2.7846 | 2.8689 | 3.0980 |
| 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 |

市场资金加权平均利率

| | R001. IB | R007. IB | GC001 | GC007 | IB0001 | IB0007 |
|-----------|----------|----------|--------|--------|--------|--------|
| 2016-4-6 | 2.0059 | 2.3907 | 2.3237 | 2.2104 | 2.0539 | 2.4283 |
| 2016-4-5 | 2.0048 | 2.4193 | 2.6210 | 2.5039 | 2.0637 | 2.4800 |
| 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 |

活跃 CTD 券情况

| | | 收盘价 | 加权平均价 | 涨跌幅 |
|----------|-----------|----------|----------|---------|
| 2016-4-6 | 150023.IB | 100.7437 | 101.0029 | -0.1239 |
| | 150005.IB | 106.2357 | 105.9569 | 0.2296 |
| 2016-4-5 | 150023.IB | 100.8687 | 100.9537 | -0.2060 |
| | 150005.IB | 105.9923 | 105.7663 | 0.2243 |

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 |