

 **金融期货晨报**

期 期 : 2016 年 4 月 12 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：周一股票市场高开收阳，上证指数重回 3000 点，创业板指大涨逾 2%。通胀企稳持续的预期、人民币汇率稳定、风险偏好改善等激发市场做多热情，大类资产配置和潜在的银行理财产品资金增量等使得市场对未来给予期待。但股指拉升仍缺乏成交量跟进，市场缺乏主要热点，3000 点上方存在较多前期套利盘压力。建议谨慎做多。

国债期货：昨日期债窄幅震荡，成交低迷，通胀数据略低于预期，银行间 7 天质押回购利率上升 30BP，国债收益率较稳定。前期空单继续持有

金融期货主要数据一览

全球利率

	0/N	1W	1M	3M	6M	12M
Shibor	1.9850	2.2910	2.7970	2.8485	2.8850	3.0420
Tibor	-	0.0591	0.0000	0.0991	0.1627	0.1836
Libor 美元	0.3775	0.3950	0.4347	0.6308	0.8949	1.2046
Libor 英镑	0.4831	0.4875	0.5098	0.5894	0.7421	0.9971
Libor 欧元	-0.3906	-0.3743	-0.3386	-0.2604	-0.1470	-0.0271

全球汇率

	2016-4-11	2016-4-8	2016-4-7	2016-4-6	2016-4-5	2016-4-4
欧元中间价	7.3696	7.3619	7.3803	7.367	7.3665	-
日元中间价	5.9748	5.9703	5.8954	5.8655	5.8203	-
美元中间价	6.4649	6.4733	6.4707	6.4754	6.4663	-
美元指数	94.0088	94.2109	94.5356	94.3598	94.6133	94.5767
欧元兑美元	1.1404	1.1395	1.1371	1.1413	1.1382	1.139

各国股市概览

	收盘价	涨跌幅%		收盘价	涨跌幅%
道指	17556.41	-0.117	FTSE100	6200.12	-0.069
标普 500	2041.99	-0.274	日经 225	15751.13	-0.445
德国 DAX	9682.99	0.631	上证综指	3033.96	1.642
法国 CAC	4312.63	0.221	深证成指	10609.60	1.883

国内金融期货前日涨跌

	收盘价	涨跌幅%	持仓量	成交量
IF1604	3213.8	1.57	29580	19938
IF1606	3131.6	2.26	8748	2164
TF1606	101.04	0.00	29880	7734
T1606	99.745	0.01	32945	12604

中债国债到期收益率

	1Y	3Y	5Y	7Y	10Y	15Y
2016-4-11	2.1776	2.3849	2.5210	2.8116	2.9091	3.1418
2016-4-8	2.1677	2.3797	2.5044	2.8065	2.9158	3.1451
2016-4-7	2.1358	2.3709	2.4947	2.8058	2.9049	3.1340
2016-4-6	2.1057	2.3466	2.4964	2.7846	2.8689	3.0980

市场资金加权平均利率

	R001. IB	R007. IB	GC001	GC007	IB0001	IB0007
2016-4-11	2.0145	2.3676	2.0607	2.2045	2.0341	2.5098
2016-4-8	2.0049	2.3676	1.9437	2.1186	2.0415	2.4734
2016-4-7	2.0007	2.3850	2.8341	1.9813	2.0388	2.386
2016-4-6	2.0059	2.3907	2.3237	2.2104	2.0539	2.4283

活跃 CTD 券情况

		收盘价	加权平均价	涨跌幅
2016-4-11	150023.IB	100.7139	100.8264	0.0945
	150005.IB	106.1029	105.7740	-0.0466
2016-4-8	150023.IB	100.6188	100.7583	0.2059
	150005.IB	106.1524	105.7567	-0.0019

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