



金融期货晨报

日期：2016年4月14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：昨日股票市场大幅放量上涨，上证指数仍处突破 3050 点。通胀企稳持续的预期、经济数据改善、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。国内外商品市场持续较大涨幅，欧美股市继续保持上行，国内市场做多热情激发，尤其以抗通胀较强的资源类板块为主。建议多单操作。

国债期货：昨日期债大幅下挫，成交量放大，国内外商品价格持续上涨，出口数据超预期增长，加之国债收益率水平已连续一周出现小幅上升，期债预期获得进一步修正。随着基本面的企稳和通胀预期的增加，市场风险偏好逐渐增强，加之短期资金利率的支撑，国债收益率阶段性上行趋势逐渐显现，期债下方空间打开。昨日央行续作 MLF，利率持平，难以对市场产生明显影响。 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	1.9960	2.3020	2.7990	2.8485	2.8905	3.0420
Tibor	-	0.0591	0.0000	0.0991	0.1627	0.1836
Libor 美元	0.3792	0.3970	0.4372	0.6296	0.8942	1.2091
Libor 英镑	0.4831	0.4872	0.5069	0.5875	0.7421	1.0084
Libor 欧元	-0.3903	-0.3743	-0.3397	-0.2621	-0.1484	-0.0266

全球汇率

	2016-4-13	2016-4-12	2016-4-11	2016-4-8	2016-4-7	2016-4-6
欧元中间价	7.3537	7.3705	7.3696	7.3619	7.3803	7.367
日元中间价	5.9456	5.9795	5.9748	5.9703	5.8954	5.8655
美元中间价	6.4591	6.4616	6.4649	6.4733	6.4707	6.4754
美元指数	94.8021	94.044	94.0088	94.2109	94.5356	94.3598
欧元兑美元	1.1276	1.1385	1.1404	1.1395	1.1371	1.1413

各国股市概览

	收盘价	涨跌幅%		收盘价	涨跌幅%
道指	17908.28	1.055	FTSE100	6362.89	1.930
标普 500	2082.42	1.004	日经 225	16381.22	2.840
德国 DAX	10026.1	2.711	上证综指	3066.64	1.422
法国 CAC	4490.31	3.323	深证成指	10684.92	1.438

国内金融期货前日涨跌

	收盘价	涨跌幅%	持仓量	成交量
IF1604	3215.4	-0.21	24317	17834
IF1606	3116.2	-0.58	8830	1644
TF1606	100.74	-0.23	27246	16547
T1606	99.55	-0.17	32611	19762

中债国债到期收益率

	1Y	3Y	5Y	7Y	10Y	15Y
2016-4-13	2.2319	2.4252	2.6179	2.8271	2.9271	3.1548
2016-4-12	2.1893	2.3949	2.5260	2.8167	2.9100	3.1377
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

市场资金加权平均利率

	R001. IB	R007. IB	GC001	GC007	IB0001	IB0007
2016-4-13	2.0294	2.4942	2.0825	2.2114	2.0435	2.5217
2016-4-12	2.0124	2.4265	1.9916	2.3371	2.0329	2.4835
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

活跃 CTD 券情况

		收盘价	加权平均价	涨跌幅
2016-4-13	150023.IB	100.4325	100.5994	-0.2055
	150005.IB	105.5735	105.6335	0.0729
2016-4-12	150023.IB	100.6393	100.8724	-0.0741
	150005.IB	105.4966	105.6868	-0.5714

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