

 **金融期货晨报**

期 期 : 2016 年 4 月 15 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，成交量较前一日萎缩。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。今日宏观经济数据公布，市场给予一定期待，但大幅反弹后市场情绪趋于冷静，经济潜在风险仍存，尤其以银行不良和快速增长的债务为主。建议多单谨慎操作。

国债期货：期债继续震荡回落，午后 2 点放量跳水，银行间国债收益率继续攀升，虽然央行进行 MLF，但市场资金仍偏紧，银行间 7 天质押式回购保持 2.4% 位置。通胀、经济预期和风险偏好持续回升，待更多经济数据发布前市场仍处偏乐观情绪。建议空单减仓，关注今日经济数据



金融期货主要数据一览

全球利率

	0/N	1W	1M	3M	6M	12M
Shibor	1.9990	2.3040	2.7990	2.8487	2.8928	3.0420
Tibor	-	0.0591	0.0000	0.0991	0.1627	0.1836
Libor 美元	0.3802	0.3973	0.4328	0.6284	0.8992	1.2176
Libor 英镑	0.4831	0.4869	0.5066	0.5878	0.7434	1.0096
Libor 欧元	-0.3896	-0.3743	-0.3391	-0.2600	-0.1486	-0.0267

全球汇率

	2016-4-14	2016-4-13	2016-4-12	2016-4-11	2016-4-8	2016-4-7
欧元中间价	7.3056	7.3537	7.3705	7.3696	7.3619	7.3803
日元中间价	5.9274	5.9456	5.9795	5.9748	5.9703	5.8954
美元中间价	6.4891	6.4591	6.4616	6.4649	6.4733	6.4707
美元指数	94.944	94.8021	94.044	94.0088	94.2109	94.5356
欧元兑美元	1.126	1.1276	1.1385	1.1404	1.1395	1.1371

各国股市概览

	收盘价	涨跌幅%		收盘价	涨跌幅%
道指	17926.43	0.101	FTSE100	6365.1	0.035
标普 500	2082.78	0.017	日经 225	16911.05	3.234
德国 DAX	10093.65	0.674	上证综指	3082.36	0.513
法国 CAC	4511.51	0.472	深证成指	10771.61	0.811

国内金融期货前日涨跌

	收盘价	涨跌幅%	持仓量	成交量
IF1604	3269.2	-0.09	8994	12552
IF1606	3192	0.04	9697	1755
TF1606	100.42	-0.32	26147	15623
T1606	99.265	-0.27	33714	17490

中债国债到期收益率

	1Y	3Y	5Y	7Y	10Y	15Y
2016-4-14	2.2259	2.4534	2.6450	2.8537	2.9352	3.1556
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

市场资金加权平均利率

	R001. IB	R007. IB	GC001	GC007	IB0001	IB0007
2016-4-14	2.0294	2.5117	3.7933	2.2838	2.0547	2.5109
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

活跃 CTD 券情况

		收盘价	加权平均价	涨跌幅
2016-4-14	150023.IB	100.4128	100.5565	-0.0196
	150005.IB	105.4910	105.6474	-0.0781
2016-4-13	150023.IB	100.4325	100.5994	-0.2055
	150005.IB	105.5735	105.6335	0.0729

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