

 **金融期货晨报**

期 期：2016年4月28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：昨日股票市场小幅回落，成交保持地量。信用风险和货币政策转向等方面的担忧成为利空因素，在关注经济能否持续企稳的真空期内，黑色类商品价格出现回落，钢铁、煤炭等板块领跌，市场题材整体轮动后，静待新的热点，缩量震荡格局延续。建议观望

国债期货：期债昨日窄幅震荡，市场资金利率较前期回落，但仍相对偏紧，现券收益率小幅回落，五债贴水仍小于十债，远季合约基差下降，IRR 抬升至前期平均水平。市场对趋势的预期改变，反弹缺乏基本面支撑，但前期跌速过快，且受利率走廊影响，五年、十年期国债收益率分别至 2.79%和 2.95%后出现回落，期债进入短期调整。建议短线做空为主。



金融期货主要数据一览

全球利率

	0/N	1W	1M	3M	6M	12M
Shibor	2.0240	2.3460	2.8330	2.8830	2.9120	3.0420
Tibor	-	0.0164	0.0000	0.0627	0.1136	0.1355
Libor 美元	0.3807	0.4003	0.4377	0.6344	0.9119	1.2426
Libor 英镑	0.4831	0.4872	0.5091	0.5911	0.7463	1.0271
Libor 欧元	-0.3903	-0.3757	-0.3491	-0.2729	-0.1564	-0.0301

全球汇率

	2016-4-27	2016-4-26	2016-4-25	2016-4-22	2016-4-21	2016-4-20
欧元中间价	7.3272	7.3161	7.307	7.3259	7.3175	7.3383
日元中间价	5.8291	5.842	5.8426	5.9322	5.9013	5.9154
美元中间价	6.4837	6.4882	6.512	6.4898	6.4803	6.4579
美元指数	94.4046	94.5137	94.757	95.0753	94.6499	94.537
欧元兑美元	1.1324	1.1296	1.127	1.123	1.1285	1.13

各国股市概览

	收盘价	涨跌幅%		收盘价	涨跌幅%
道指	18041.55	0.285	FTSE100	6319.91	0.563
标普 500	2095.15	0.165	日经 225	17290.49	-0.362
德国 DAX	10299.83	0.392	上证综指	2953.67	-0.372
法国 CAC	4559.4	0.578	深证成指	10174.16	-0.350

国内金融期货前日涨跌

	收盘价	涨跌幅%	持仓量	成交量
IF1605	3125.8	-0.17	31568	14153
IF1606	3086.8	-0.01	9902	1294
TF1606	100.54	-0.04	15418	7598
T1606	99.345	-0.02	24696	12679

中债国债到期收益率

	1Y	3Y	5Y	7Y	10Y	15Y
2016-4-27	2.2805	2.5568	2.7334	2.9796	2.9108	3.1990
2016-4-26	2.3011	2.5603	2.7635	3.0046	2.9212	3.2091
2016-4-25	2.3273	2.5796	2.7983	3.0544	2.9362	3.2241
2016-4-22	2.2706	2.4963	2.7173	2.9946	2.9309	3.1841

市场资金加权平均利率

	R001. IB	R007. IB	GC001	GC007	IB0001	IB0007
2016-4-27	2.0308	2.6702	1.8541	2.1334	2.0825	2.5995
2016-4-26	2.0421	2.5986	1.8515	2.3784	2.0887	2.6378
2016-4-25	2.1217	2.6424	2.2390	2.7609	2.1066	2.6435
2016-4-22	2.1400	2.6723	2.2492	2.4393	2.0929	2.6281

活跃 CTD 券情况

		收盘价	加权平均价	涨跌幅
2016-4-27	150023.IB	100.3276	100.6112	-0.2048
	150005.IB	105.0690	105.3752	-0.3722
2016-4-26	150023.IB	100.5335	100.4301	0.2872
	150005.IB	105.4615	105.4671	0.0000

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