

## 金融期货晨报

日期：2016年5月3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：**上周股票市场窄幅震荡，成交保持地量。信用风险和货币政策趋稳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，市场趋于谨慎，市场题材整体轮动后，静待新的热点，缩量震荡格局延续。信用债市场回调，风险偏好回落，对股票市场情绪造成不利影响。建议观望

**国债期货：**上周国债期货出现反弹，主力继续换季，远季合约走势强于当季。经济基本面仍主导国债走势，短期流动性紧张状态的缓解使得期债出现反弹。进入5月，上半年经济形势的关注度将会提高，市场静待更多经济数据的公布和政策面的进一步走向。经济潜在风险仍存，流动性紧平衡状态将持续，短期缺乏方向性指引，经历4月回调后市场趋谨慎，但收益率上升的方向性需更多基本面支持。预计短期期债将处于震荡偏弱走势，中期维持偏空观点。建议短线观望，中线轻仓空单介入



## 金融期货主要数据一览

### 全球利率

	0/N	1W	1M	3M	6M	12M
Shibor	2.0490	2.3860	2.8530	2.9080	2.9270	3.0420
Tibor	-	0.0164	0.0000	0.0627	0.1136	0.1355
Libor 美元	0.3827	0.4040	0.4388	0.6366	0.9047	1.2300
Libor 英镑	0.4831	0.4872	0.5101	0.5921	0.7444	1.0265
Libor 欧元	-0.3917	-0.3781	-0.3493	-0.2724	-0.1551	-0.0299

### 全球汇率

	2016-5-2	2016-4-29	2016-4-28	2016-4-27	2016-4-26	2016-4-25
欧元中间价	-	7.3439	7.35	7.3272	7.3161	7.307
日元中间价	-	5.982	5.8231	5.8291	5.842	5.8426
美元中间价	-	6.4589	6.4954	6.4837	6.4882	6.512
美元指数	92.6008	93.0482	93.7716	94.4046	94.5137	94.757
欧元兑美元	1.1526	1.1448	1.135	1.1324	1.1296	1.127

### 各国股市概览

	收盘价	涨跌幅%		收盘价	涨跌幅%
道指	17891.16	0.661	FTSE100	-	-
标普 500	2081.43	0.781	日经 225	16147.38	-3.112
德国 DAX	10123.27	0.840	上证综指	-	-
法国 CAC	4442.75	0.311	深证成指	-	-

### 国内金融期货前日涨跌

	收盘价	涨跌幅%	持仓量	成交量
IF1605	3121.2	-0.17	32629	15287
IF1606	3082.4	-0.12	10155	1322
TF1606	100.6	-0.08	13603	5334
T1606	99.515	-0.09	21926	8118

## 中债国债到期收益率

	1Y	3Y	5Y	7Y	10Y	15Y
2016-4-29	2.307	2.5817	2.7282	2.9594	2.8913	3.1958
2016-4-28	2.3029	2.5568	2.7436	2.9546	2.8863	3.1868
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

## 市场资金加权平均利率

	R001. IB	R007. IB	GC001	GC007	IB0001	IB0007
2016-4-29	2.1035	2.5158	1.7502	1.9004	2.1134	2.505
2016-4-28	2.0262	2.6298	2.9196	1.8259	2.0657	2.6397
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

## 活跃 CTD 券情况

		收盘价	加权平均价	涨跌幅
2016-4-29	150023.IB	100.7414	100.6759	0.1659
	150005.IB	105.3921	105.5708	0.0014
2016-4-28	150023.IB	100.5745	100.5566	0.2461
	150005.IB	105.3906	105.5895	0.3061

## 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