

 **金融期货晨报**

期 期：2016年5月4日

期 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：昨日股票市场出现普涨，成交量放大，中小票涨幅靠前。政治局会议关于保持股市健康发展的表态提振市场信心，国内改革政策陆续落地，市场情绪推动反弹，但货币政策更加趋于稳健，债券违约风险仍存，制约市场向上空间，总体上判断市场将延续震荡。建议短线多单操作

国债期货：期债跳空高开，财政部出台营改增“补丁”，质押式回购和政策性金融债利息收入免征增值税，资金利率和债市收益率下行，短期利好释放。经济增速及通胀仍是中期走势的决定性因素，近期资金面缓解使得期债获得短期反弹，市场仍关注于二季度经济情况。建议短线观望

金融期货主要数据一览

全球利率

	0/N	1W	1M	3M	6M	12M
Shibor	2.0033	2.3400	2.8489	2.9044	2.9300	3.0422
Tibor	-	0.0164	0.0000	0.0627	0.1136	0.1355
Libor 美元	0.3837	0.4055	0.4358	0.6366	0.9042	1.2295
Libor 英镑	0.4806	0.4856	0.5073	0.5906	0.7444	1.0215
Libor 欧元	-0.3896	-0.3781	-0.3493	-0.2717	-0.1551	-0.0306

全球汇率

	2016-5-3	2016-5-2	2016-4-29	2016-4-28	2016-4-27	2016-4-26
欧元中间价	7.4476	-	7.3439	7.35	7.3272	7.3161
日元中间价	6.0789	-	5.982	5.8231	5.8291	5.842
美元中间价	6.4565	-	6.4589	6.4954	6.4837	6.4882
美元指数	93.074	92.6008	93.0482	93.7716	94.4046	94.5137
欧元兑美元	1.1495	1.1526	1.1448	1.135	1.1324	1.1296

各国股市概览

	收盘价	涨跌幅%		收盘价	涨跌幅%
道指	17750.91	-0.784	FTSE100	6185.59	-0.902
标普 500	2063.37	-0.868	日经 225	-	-
德国 DAX	9926.77	-1.941	上证综指	2992.64	1.849
法国 CAC	4371.98	-1.593	深证成指	10441.92	2.962

国内金融期货前日涨跌

	收盘价	涨跌幅%	持仓量	成交量
IF1605	3200	2.20	32682	17112
IF1606	3155	2.08	10431	2100
TF1606	100.83	0.23	12923	6153
T1606	99.75	0.24	21408	7632

中债国债到期收益率

	1Y	3Y	5Y	7Y	10Y	15Y
2016-5-3	2.2752	2.5754	2.7092	2.9495	2.8890	3.1985
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

市场资金加权平均利率

	R001. IB	R007. IB	GC001	GC007	IB0001	IB0007
2016-5-3	2.0266	2.4348	1.8772	2.1979	2.0441	2.5454
2016-4-29	2.1035	2.5158	1.7502	1.9004	2.1134	2.5050
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

活跃 CTD 券情况

		收盘价	加权平均价	涨跌幅
2016-5-3	150023.IB	100.8207	100.7044	0.0787
	150005.IB	105.7055	105.6767	0.2974
2016-4-29	150023.IB	100.7414	100.6759	0.1659
	150005.IB	105.3921	105.5708	0.0014

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