

 **金融期货晨报**

期 期 : 2016 年 5 月 5 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：昨日股票市场维持震荡，上证指数围绕 2900 点位置运行，前期领涨的煤炭钢铁板块表现继续靠后。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，但货币政策总体更加趋于稳健，定向宽松的政策加强。债券违约风险仍存，外围股市表现不佳，市场融资交易趋冷，制约反弹空间，总体上判断市场以稳为主，延续震荡。建议短线多单操作。

国债期货：昨日期债震荡上行，成交量放大，主力换季仍未完成。10 年期国债招标守住 2.9% 关口，获得 3 倍认购倍数，国债二级市场平稳，交投清淡。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	2.0000	2.3280	2.8450	2.8990	2.9330	3.0420
Tibor	-	0.0164	0.0000	0.0627	0.1136	0.1355
Libor 美元	0.3857	0.4050	0.4359	0.6329	0.9072	1.2318
Libor 英镑	0.4831	0.4869	0.5073	0.5896	0.7408	1.0203
Libor 欧元	-0.3929	-0.3781	-0.3493	-0.2739	-0.1551	-0.0291

全球汇率

	2016-5-4	2016-5-3	2016-5-2	2016-4-29	2016-4-28	2016-4-27
欧元中间价	7.4613	7.4476	-	7.3439	7.35	7.3272
日元中间价	6.0917	6.0789	-	5.982	5.8231	5.8291
美元中间价	6.4943	6.4565	-	6.4589	6.4954	6.4837
美元指数	93.2766	93.074	92.6008	93.0482	93.7716	94.4046
欧元兑美元	1.1484	1.1495	1.1526	1.1448	1.135	1.1324

各国股市概览

	收盘价	涨跌幅%		收盘价	涨跌幅%
道指	17651.26	-0.561	FTSE100	6112.02	-1.189
标普 500	2051.12	-0.594	日经 225	-	-
德国 DAX	9828.25	-0.992	上证综指	2991.27	-0.046
法国 CAC	4324.23	-1.092	深证成指	10422.80	-0.183

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	100.88	0.03	11900	5061
T1606	99.845	0.07	20162	9708

中债国债到期收益率

	1Y	3Y	5Y	7Y	10Y	15Y
2016-5-4	2.3126	2.5847	2.7190	2.9346	2.8965	3.2187
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

市场资金加权平均利率

	R001. IB	R007. IB	GC001	GC007	IB0001	IB0007
2016-5-4	2.0388	2.4420	1.7076	2.0741	2.0544	2.5468
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	2.505
2016-4-28	2.0262	2.6298	2.9196	1.8259	2.0657	2.6397

活跃 CTD 券情况

		收盘价	加权平均价	涨跌幅
2016-5-4	150023.IB	100.7379	100.6874	-0.0821
	150005.IB	105.6967	105.6876	-0.0083
2016-5-3	150023.IB	100.8207	100.7044	0.0787
	150005.IB	105.7055	105.6767	0.2974

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