

 **金融期货晨报**

期 期 : 2016 年 5 月 10 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：昨日人民日报文章对市场预期产生重大影响，部分行业政策托底工作将发生改变。前期市场存在较大分歧，较平衡的市场被打破，市场对政策的偏好预期改变，股票市场部分行业将出现明显回落，市场信心在短期将遭受打击。建议观望

国债期货：期债高开大幅上涨，成交量放大。人民日报权威人士文章对市场产生明显影响，前期市场部分预期出现改变，并将持续，利率债作为避险资产将保持较强需求，经济预期放平，但国债收益率大幅下行不具备基本面支撑，趋势性交易机会难以出现，此次上涨可看做前期对需求刺激乐观预期的调整，维持震荡偏强走势。目前 09 合约期现基差大幅收窄，但 IRR 水平仍为负。建议继续观望

金融期货主要数据一览

全球利率

	0/N	1W	1M	3M	6M	12M
Shibor	1.9990	2.3230	2.8410	2.8920	2.9325	3.0420
Tibor	-	0.0164	0.0000	0.0627	0.1136	0.1355
Libor 美元	0.3850	0.4051	0.4379	0.6296	0.9072	1.2242
Libor 英镑	0.4825	0.4869	0.5113	0.5878	0.7308	0.9946
Libor 欧元	-0.3943	-0.3793	-0.3520	-0.2760	-0.1570	-0.0294

全球汇率

	2016-5-9	2016-5-8	2016-5-6	2016-5-5	2016-5-4	2016-5-3
欧元中间价	7.4146	0	7.4289	7.4765	7.4613	7.4476
日元中间价	6.0613	0	6.0764	6.0848	6.0917	6.0789
美元中间价	6.5105	0	6.5202	6.5128	6.4943	6.4565
美元指数	94.1528	93.903	93.851	93.7589	93.2766	93.074
欧元兑美元	1.1382	1.1396	1.1399	1.1401	1.1484	1.1495

各国股市概览

	收盘价	涨跌幅%		收盘价	涨跌幅%
道指	17705.91	-0.196	FTSE100	6114.81	-0.178
标普 500	2058.69	0.075	日经 225	16216.03	0.679
德国 DAX	9980.49	1.120	上证综指	2832.11	-2.785
法国 CAC	4322.81	0.501	深证成指	9790.48	-3.070

国内金融期货前日涨跌

	收盘价	涨跌幅%	持仓量	成交量
IF1605	3022	-3.08	29286	16087
IF1606	2985	-2.86	11725	3041
TF1606	101.13	0.21	9002	5809
T1606	100.245	0.36	15992	9929

中债国债到期收益率

	1Y	3Y	5Y	7Y	10Y	15Y
2016-5-9	2.3526	2.5733	2.6895	2.9146	2.8818	3.2137
2016-5-6	2.3403	2.5877	2.7243	2.9395	2.9016	3.2237
2016-5-5	2.35	2.5771	2.7194	2.9397	2.9017	3.2287
2016-5-4	2.3126	2.5847	2.7190	2.9346	2.8965	3.2187

市场资金加权平均利率

	R001. IB	R007. IB	GC001	GC007	IB0001	IB0007
2016-5-9	2.0261	2.4471	1.6310	2.0130	2.0476	2.5216
2016-5-6	2.0234	2.4255	1.5869	2.0023	2.0564	2.3853
2016-5-5	2.0254	2.4277	2.5075	1.9648	2.0526	2.4914
2016-5-4	2.0388	2.4420	1.7076	2.0741	2.0544	2.5468

活跃 CTD 券情况

		收盘价	加权平均价	涨跌幅
2016-5-9	150023.IB	100.8604	100.8452	0.2045
	160004.IB	99.8290	99.7901	0.2112
2016-5-6	150023.IB	100.6546	101.9469	-0.0007
	160004.IB	99.6186	99.7245	-0.0419

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