

 **金融期货晨报**

期 期：2016 年 6 月 1 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：**昨日股票市场放量上涨，沪指突破 2900 点，券商板块早盘带动市场人气，各板块均大幅上涨。IF1606 放量突破 3150 点，回升至前期盘整高位。经过较长时间缩量盘整，场外资金蠢蠢欲动，但短期缺乏支撑反弹的实质性利多因素，增量资金入场持续性存疑。未来经济增速和企业经营情况难以得到大幅逆转，此次反弹仅为确认中期底部。建议短线多单操作

**国债期货：**期债窄幅震荡，央行加量逆回购，银行间回购利率小幅回落，昨日上午国开行招标情况较好，倍数达 4 倍以上，中标利率均低于二级市场。短期期债仍处震荡，缺乏方向性，十年期国债收益率于 2.98% 左右窄幅波动。建议短线偏空操作。

# 金融期货主要数据一览

## 全球利率

	0/N	1W	1M	3M	6M	12M
Shibor	2.0100	2.3380	2.8460	2.9460	2.9822	3.0500
Tibor	-	0.0164	0.0000	0.0627	0.1127	0.1346
Libor 美元	0.3850	0.4070	0.4567	0.6731	0.9781	1.3167
Libor 英镑	0.4838	0.4939	0.5138	0.5889	0.7350	1.0103
Libor 欧元	-0.3971	-0.3800	-0.3529	-0.2817	-0.1613	-0.0339

## 全球汇率

	2016-5-31	2016-5-30	2016-5-27	2016-5-26	2016-5-25	2016-5-24
欧元中间价	7.3318	7.3015	7.3334	7.318	7.3118	7.3424
日元中间价	5.932	5.9365	5.9706	5.9597	5.9662	5.99
美元中间价	6.579	6.5784	6.549	6.5552	6.5693	6.5468
美元指数	95.8412	95.7093	95.7397	95.1449	95.3895	95.632
欧元兑美元	1.1128	1.1135	1.1109	1.1192	1.1156	1.1134

## 各国股市概览

	收盘价	涨跌幅%		收盘价	涨跌幅%
道指	17787.2	-0.481	FTSE100	6230.79	-0.638
标普 500	2096.96	-0.100	日经 225	17234.98	0.978
德国 DAX	10262.74	-0.682	上证综指	2916.62	3.336
法国 CAC	4505.62	-0.525	深证成指	10159.93	4.003

## 国内金融期货前日涨跌

	收盘价	涨跌幅%	持仓量	成交量
IF1606	3158.8	4.05	36012	21142
IF1609	3080	4.63	4464	1321
TF1609	100.32	0.13	25626	6799
T1609	99.145	0.19	32307	13465

## 中债国债到期收益率

	1Y	3Y	5Y	7Y	10Y	15Y
2016-5-31	2.3201	2.6074	2.7513	2.9819	2.9851	3.3667
2016-5-30	2.3196	2.6098	2.7561	2.9824	2.9776	3.3592
2016-5-27	2.3168	2.6034	2.7593	2.9769	2.9451	3.3267
2016-5-26	2.3194	2.5644	2.7571	2.9721	2.9401	3.3217

## 市场资金加权平均利率

	R001. IB	R007. IB	GC001	GC007	IB0001	IB0007
2016-5-31	2.0408	2.4014	2.5230	2.3057	2.0472	2.544
2016-5-30	2.0226	2.4505	2.1269	2.0075	2.0637	2.5144
2016-5-27	2.0248	2.5033	2.0113	1.8805	2.0634	2.5499
2016-5-26	2.0244	2.5070	2.0980	1.7918	2.0531	2.4721

## 活跃 CTD 券情况

		收盘价	加权平均价	涨跌幅
2016-5-31	160010.IB	99.3581	99.4171	0.0429
	160004.IB	99.4124	99.3479	0.0421
2016-5-30	160010.IB	99.3155	99.6844	-0.3386
	160004.IB	99.3706	99.826	-0.1194

## 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