



金融期货晨报

期 期 : 2016 年 6 月 2 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：昨日股票市场窄幅震荡，成交量略有回落但较前期仍处高位，沪指 2900 点上方运行，周二领涨板块出现回调，板块轮动明显。IF1606 小幅回落，仍处 3100 点上方。缩量震荡后放量拉升构筑中期底部，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，场内获利及解套盘将造成压力。未来经济增速和企业经营情况难以得到大幅逆转。建议今日观望

国债期货：期债窄幅震荡，银行间 7 天资金利率上升 5BP，一级市场国债招标情况一般，10 年期倍数 3.02，中标利率走高至 2.995%，二级市场 10 年期 160010 券收益率攀升至 3%，7 年期 160006 券收益率亦走高 1BP。期货方面，五债表现仍略强于十债，期现价差维持低位，短期市场资金季节性趋紧。昨日 PMI 虽表现出疲态，但仍处 L 型预期之中，对未来预期无实质性影响。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	2.0060	2.3370	2.8420	2.9460	2.9823	3.0500
Tibor	-	0.0164	0.0000	0.0627	0.1127	0.1346
Libor 美元	0.3865	0.4082	0.4689	0.6858	0.9931	1.3374
Libor 英镑	0.4788	0.4905	0.5151	0.5882	0.7350	1.0103
Libor 欧元	-0.3971	-0.3800	-0.3529	-0.2819	-0.1616	-0.0333

全球汇率

	2016-6-1	2016-5-31	2016-5-30	2016-5-27	2016-5-26	2016-5-25
欧元中间价	7.3308	7.3318	7.3015	7.3334	7.318	7.3118
日元中间价	5.9543	5.932	5.9365	5.9706	5.9597	5.9662
美元中间价	6.5889	6.579	6.5784	6.549	6.5552	6.5693
美元指数	95.4214	95.8412	95.7093	95.7397	95.1449	95.3895
欧元兑美元	1.1186	1.1128	1.1135	1.1109	1.1192	1.1156

各国股市概览

	收盘价	涨跌幅%		收盘价	涨跌幅%
道指	17789.67	0.014	FTSE100	6191.93	-0.624
标普 500	2099.33	0.113	日经 225	16955.73	-1.620
德国 DAX	10204.44	-0.568	上证综指	2913.51	-0.107
法国 CAC	4475.39	-0.671	深证成指	10209.14	0.484

国内金融期货前日涨跌

	收盘价	涨跌幅%	持仓量	成交量
IF1606	3131.8	-0.35	34309	13754
IF1609	3064.2	-0.07	4551	929
TF1609	100.315	0.03	25783	4808
T1609	99.075	-0.02	32959	11538

中债国债到期收益率

	1Y	3Y	5Y	7Y	10Y	15Y
2016-6-1	2.3438	2.6019	2.7519	2.9858	2.9952	3.3768
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

市场资金加权平均利率

	R001. IB	R007. IB	GC001	GC007	IB0001	IB0007
2016-6-1	2.0262	2.4676	2.0818	2.6289	2.075	2.3943
2016-5-31	2.0408	2.4014	2.5230	2.3057	2.0472	2.5440
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

活跃 CTD 券情况

		收盘价	加权平均价	涨跌幅
2016-6-1	160010.IB	99.3581	0.0000	0.0000
	160004.IB	99.3254	99.6477	-0.0875
2016-5-31	160010.IB	99.3581	99.4171	0.0429
	160004.IB	99.4124	99.3479	0.0421

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