



# 金融期货晨报

日期：2016年6月3日

期谚日日谈

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：**昨日股票市场继续震荡，成交量进一步回落但较前期仍处高位，沪指 2900 点上方运行，题材股表现较强，习近平提出科技创新三个方面，长期利好相关板块。IF1606 窄幅震荡，仍处 3100 点上方。大盘短期缺乏支撑整体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，未来分化加大，部分题材板块将维持较强表现，大盘蓝筹则以稳为主。建议 IF 谨慎做多，中线多 IC 空 IH。

**国债期货：**昨日期债开盘后快速下挫，银行间国债收益率全面上升，10 年期活跃券达到 3.01%，午后 7 年期活跃券也达到 3% 关口，交易性较强的 10 年国开收益率较昨日上升 1.25BP。期货走势并未完全反应现券情况，前期十年期国债收益率持续上升，但期债周二反而走强，T1609 期现价差处 -0.13，保持较窄水平。随着年中临近，叠加美元走强及 MPA 考核，短期流动性趋紧，同时金融降杠杆效果开始显现以及利率债供应量增大，期债价格承压。建议空单谨慎持有。

# 金融期货主要数据一览

## 全球利率

	0/N	1W	1M	3M	6M	12M
Shibor	2.0040	2.3420	2.8380	2.9460	2.9823	3.0500
Tibor	-	0.0164	0.0000	0.0627	0.1127	0.1346
Libor 美元	0.3855	0.4083	0.4696	0.6813	0.9854	1.3284
Libor 英镑	0.4831	0.4847	0.5116	0.5876	0.7306	0.9984
Libor 欧元	-0.3957	-0.3800	-0.3550	-0.2811	-0.1601	-0.0304

## 全球汇率

	2016-6-2	2016-6-1	2016-5-31	2016-5-30	2016-5-27	2016-5-26
欧元中间价	7.355	7.3308	7.3318	7.3015	7.3334	7.318
日元中间价	6.006	5.9543	5.932	5.9365	5.9706	5.9597
美元中间价	6.5688	6.5889	6.579	6.5784	6.549	6.5552
美元指数	95.5545	95.4214	95.8412	95.7093	95.7397	95.1449
欧元兑美元	1.115	1.1186	1.1128	1.1135	1.1109	1.1192

## 各国股市概览

	收盘价	涨跌幅%		收盘价	涨跌幅%
道指	17838.56	0.275	FTSE100	6185.61	-1.358
标普 500	2105.26	0.282	日经 225	16562.55	-1.617
德国 DAX	10208	-0.761	上证综指	2925.23	0.402
法国 CAC	4466	-1.080	深证成指	10274.03	0.636

## 国内金融期货前日涨跌

	收盘价	涨跌幅%	持仓量	成交量
IF1606	3135.4	-0.01	33751	10165
IF1609	3054.8	-0.38	4588	647
TF1609	100.22	-0.08	26048	4528
T1609	98.945	-0.14	33052	12030

## 中债国债到期收益率

	1Y	3Y	5Y	7Y	10Y	15Y
2016-6-2	2.3753	2.6069	2.7649	2.9982	3.0127	3.3943
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

## 市场资金加权平均利率

	R001. IB	R007. IB	GC001	GC007	IB0001	IB0007
2016-6-2	2.0213	2.3716	3.2485	2.8542	2.0922	2.3915
2016-6-1	2.0262	2.4676	2.0818	2.6289	2.0750	2.3943
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

## 活跃 CTD 券情况

		收盘价	加权平均价	涨跌幅
2016-6-2	160010.IB	99.1034	99.3032	-0.2563
	160004.IB	99.1632	99.6152	-0.1633
2016-6-1	160010.IB	99.3581	-	-
	160004.IB	99.3254	99.6477	-0.0875

## 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