



金融期货晨报

日期：2016年6月4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：上周股票市场放量反弹后小幅震荡走高，成交量明显增加，沪指2900点上方运行，题材股表现较强。IF1606突破3100点，成交量放大。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：国债期货上周窄幅震荡，五债与十债走势出现分化期债价格较为敏感，跟随国开债的现象仍然明显，国开债近期走势强于国债导致期现价差持续收窄。短期看，金融降杠杆、美联储加息预期提升、货币政策更趋稳健将会成为近期主要风险，期债价格易下难上，但3%收益率完全突破仍需更多利空因素的支撑，美国就业数据降低加息预期，现券及期债买盘需求未明显减少。建议观望为主。



金融期货主要数据一览

全球利率

	0/N	1W	1M	3M	6M	12M
Shibor	1.9990	2.3380	2.8350	2.9470	2.9833	3.0500
Tibor	-	0.0164	0.0000	0.0627	0.1127	0.1346
Libor 美元	0.3861	0.4092	0.4648	0.6822	0.9857	1.3314
Libor 英镑	0.4819	0.4859	0.5110	0.5858	0.7248	0.9853
Libor 欧元	-0.3957	-0.3800	-0.3507	-0.2776	-0.1630	-0.0276

全球汇率

	2016-6-3	2016-6-2	2016-6-1	2016-5-31	2016-5-30	2016-5-27
欧元中间价	7.3347	7.355	7.3308	7.3318	7.3015	7.3334
日元中间价	6.0431	6.006	5.9543	5.932	5.9365	5.9706
美元中间价	6.5793	6.5688	6.5889	6.579	6.5784	6.549
美元指数	93.9222	95.5545	95.4214	95.8412	95.7093	95.7397
欧元兑美元	1.1363	1.115	1.1186	1.1128	1.1135	1.1109

各国股市概览

	收盘价	涨跌幅%		收盘价	涨跌幅%
道指	17807.06	-0.177	FTSE100	6209.63	0.388
标普 500	2099.13	-0.291	日经 225	16642.23	0.481
德国 DAX	10103.26	-1.026	上证综指	2938.68	0.460
法国 CAC	4421.78	-0.990	深证成指	10344.91	0.690

国内金融期货前日涨跌

	收盘价	涨跌幅%	持仓量	成交量
IF1606	3177.4	1.42	34317	14543
IF1609	3099	1.52	4740	945
TF1609	100.27	0.05	26416	5837
T1609	98.985	0.05	33190	11168

中债国债到期收益率

	1Y	3Y	5Y	7Y	10Y	15Y
2016-6-3	2.3975	2.6053	2.7833	3.0026	3.0152	3.3930
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

市场资金加权平均利率

	R001. IB	R007. IB	GC001	GC007	IB0001	IB0007
2016-6-3	2.0214	2.3731	2.4608	2.6448	2.055	2.5486
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	2.075	2.3943
2016-5-31	2.0408	2.4014	2.5230	2.3057	2.0472	2.5440

活跃 CTD 券情况

		收盘价	加权平均价	涨跌幅
2016-6-3	160010.IB	99.0617	99.0870	-0.0421
	160004.IB	99.0809	99.4370	-0.0830
2016-6-2	160010.IB	99.1034	99.3032	-0.2563
	160004.IB	99.1632	99.6152	-0.1633

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