

 金融期货晨报

期 期 : 2016 年 6 月 7 日

期 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：**股票市场窄幅震荡，成交量回落，沪指 2900 点上方运行，题材股表现仍然较强。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：**昨日期债高开震荡，受周末美国就业数据大幅低于预期影响，市场对美联储加息预期回落，人民币压力暂缓。10 年期国债收益率回落 1BP，期债价格涨幅高于现券，期现价差进一步缩小，TF1609 转为升水，T1609 贴水 0.09，基本面未出现明显变化，年中时点叠加金融降杠杆政策，期债价格仍然面临压力，今日利多释放后价格缺乏继续上升支撑。建议短线空单操作。

# 金融期货主要数据一览

## 全球利率

	0/N	1W	1M	3M	6M	12M
Shibor	1.9980	2.3370	2.8390	2.9460	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

	2016-6-6	2016-6-3	2016-6-2	2016-6-1	2016-5-31	2016-5-30
欧元中间价	7.4377	7.3347	7.355	7.3308	7.3318	7.3015
日元中间价	6.1406	6.0431	6.006	5.9543	5.932	5.9365
美元中间价	6.5497	6.5793	6.5688	6.5889	6.579	6.5784
美元指数	94.0234	93.9222	95.5545	95.4214	95.8412	95.7093
欧元兑美元	1.1357	1.1363	1.115	1.1186	1.1128	1.1135

## 各国股市概览

	收盘价	涨跌幅%		收盘价	涨跌幅%
道指	17920.33	0.636	FTSE100	6273.4	1.027
标普 500	2109.41	0.490	日经 225	16580.03	-0.374
德国 DAX	10121.08	0.176	上证综指	2934.10	-0.156
法国 CAC	4423.38	0.036	深证成指	10363.09	0.176

## 国内金融期货前日涨跌

	收盘价	涨跌幅%	持仓量	成交量
IF1606	3157.4	-0.51	32375	12282
IF1609	3081.6	-0.50	4838	677
TF1609	100.33	0.07	26665	6263
T1609	99.04	0.09	33356	9241

## 中债国债到期收益率

	1Y	3Y	5Y	7Y	10Y	15Y
2016-6-6	2.4022	2.6058	2.7710	2.9886	3.0041	3.3874
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

## 市场资金加权平均利率

	R001. IB	R007. IB	GC001	GC007	IB0001	IB0007
2016-6-6	2.0262	2.3868	2.4228	2.1892	2.0485	2.5564
2016-6-3	2.0214	2.3731	2.4608	2.6448	2.0550	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	2.0750	2.3943

## 活跃 CTD 券情况

		收盘价	加权平均价	涨跌幅
2016-6-6	160010.IB	99.1466	99.0098	0.0857
	160004.IB	99.0809	99.5921	0.0000
2016-6-3	160010.IB	99.0617	99.087	-0.0421
	160004.IB	99.0809	99.437	-0.0830

## 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