

 **金融期货晨报**

期 期：2016年6月8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：股票市场窄幅震荡，成交量继续回落，沪指 2900 点上方运行。

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 观望为主，中线多 IC 空 IH。

国债期货：期债弱势震荡，一级市场国开招标需求较旺，但二级市场收益率出现 1BP 左右回升。央行 OMO 及 MLF 常态化操作，但资金利率小幅太高，市场对年中流动性保持担忧。短期十债收益率将 3% 位置震荡，资金面制约收益率下行，基本面缺乏方向性影响。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	2.0000	2.3400	2.8380	2.9460	2.9834	3.0500
Tibor	-	0.0164	0.0000	0.0627	0.1127	0.1346
Libor 美元	0.3861	0.4078	0.4471	0.6607	0.9542	1.2856
Libor 英镑	0.4819	0.4891	0.5085	0.5821	0.7185	0.9646
Libor 欧元	-0.3957	-0.3800	-0.3521	-0.2797	-0.1637	-0.0290

全球汇率

	2016-6-7	2016-6-6	2016-6-3	2016-6-2	2016-6-1	2016-5-31
欧元中间价	7.4499	7.4377	7.3347	7.355	7.3308	7.3318
日元中间价	6.1101	6.1406	6.0431	6.006	5.9543	5.932
美元中间价	6.5618	6.5497	6.5793	6.5688	6.5889	6.579
美元指数	93.8621	94.0234	93.9222	95.5545	95.4214	95.8412
欧元兑美元	1.1356	1.1357	1.1363	1.115	1.1186	1.1128

各国股市概览

	收盘价	涨跌幅%		收盘价	涨跌幅%
道指	17938.28	0.100	FTSE100	6284.53	0.177
标普 500	2112.13	0.129	日经 225	16675.45	0.576
德国 DAX	10287.68	1.646	上证综指	2936.05	0.066
法国 CAC	4475.86	1.186	深证成指	10347.84	-0.147

国内金融期货前日涨跌

	收盘价	涨跌幅%	持仓量	成交量
IF1606	3160	0.10	30794	10101
IF1609	3074.2	-0.15	4830	523
TF1609	100.27	-0.06	26999	3717
T1609	98.955	-0.11	33324	7208

中债国债到期收益率

	1Y	3Y	5Y	7Y	10Y	15Y
2016-6-7	2.3979	2.6021	2.7815	2.9893	3.0071	3.3904
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

市场资金加权平均利率

	R001. IB	R007. IB	GC001	GC007	IB0001	IB0007
2016-6-7	2.0254	2.3884	5.1895	2.0126	2.0413	2.5408
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	2.055	2.5486
2016-6-2	2.0213	2.3716	3.2485	2.8542	2.0922	2.3915

活跃 CTD 券情况

		收盘价	加权平均价	涨跌幅
2016-6-7	160010.IB	99.0621	99.1335	-0.0852
	160004.IB	99.0812	99.5013	0.0003
2016-6-6	160010.IB	99.1466	99.0098	0.0857
	160004.IB	99.0809	99.5921	0.0000

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