

 金融期货晨报

期 期 : 2016 年 6 月 14 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：昨日股票市场午后加速回落，成交量放大，沪指大幅下跌 3.21% 至 2833 点。英国脱欧概率上升、5 月投资数据超预期回落及外盘持续偏空，叠加 A 股解禁袭来，昨日避险情绪再次集中释放。本周国际市场将公布的重大事件较为密集，美联储 FOMC 会议、日本央行议息会议、MSCI 将公布是否纳入 A 股。前期热点板块退潮，多条均线的失守对市场信心造成较大打击，放量大跌显示资金抛售意愿较浓，但基本面缺乏持续做空因素，维持底部震荡走势的观点。建议观望

国债期货：期债震荡上行，成交保持低位，受通胀及投资数据影响，国债收益率略回落 0.25BP。假期国际市场避险情绪增强，但对国内市场影响不大，短期十年期国债收益率维持 3% 位置窄幅波动，稳货币和宽财政对经济的托底使得市场并未对短期数据表现出过分担忧，短期期债缩量整理，缺乏方向性。建议观望。

金融期货主要数据一览

全球利率

	0/N	1W	1M	3M	6M	12M
Shibor	2.0000	2.3420	2.8440	2.9476	2.9833	3.0500
Tibor	-	0.0164	0.0000	0.0627	0.1127	0.1346
Libor 美元	0.3861	0.4119	0.4466	0.6556	0.9442	1.2735
Libor 英镑	0.4813	0.4866	0.5076	0.5752	0.7179	0.9678
Libor 欧元	-0.3957	-0.3807	-0.3576	-0.2819	-0.1646	-0.0283

全球汇率

	2016-6-13	2016-6-8	2016-6-7	2016-6-6	2016-6-3	2016-6-2
欧元中间价	7.4048	7.4503	7.4499	7.4377	7.3347	7.355
日元中间价	6.1817	6.1207	6.1101	6.1406	6.0431	6.006
美元中间价	6.5805	6.5593	6.5618	6.5497	6.5793	6.5688
美元指数	94.4217	93.5436	93.8621	94.0234	93.9222	95.5545
欧元兑美元	1.1286	1.1399	1.1356	1.1357	1.1363	1.115

各国股市概览

	收盘价	涨跌幅%		收盘价	涨跌幅%
道指	17732.48	-0.744	FTSE100	6044.97	-1.158
标普 500	2079.06	-0.812	日经 225	16019.18	-3.507
德国 DAX	9657.44	-1.802	上证综指	2833.07	-3.214
法国 CAC	4227.02	-1.851	深证成指	9862.58	-4.403

国内金融期货前日涨跌

	收盘价	涨跌幅%	持仓量	成交量
IF1606	3028.8	-3.88	25919	15138
IF1609	2936.6	-4.06	4946	989
TF1609	100.34	0.14	26541	5339
T1609	99.19	0.25	33428	10929

中债国债到期收益率

	1Y	3Y	5Y	7Y	10Y	15Y
2016-6-13	2.413	2.6079	2.8140	2.9935	2.9979	3.3772
2016-6-12	2.416	2.6086	2.8076	3.0135	3.0053	3.3846
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

市场资金加权平均利率

	R001. IB	R007. IB	GC001	GC007	IB0001	IB0007
2016-6-13	2.0186	2.3905	2.1284	2.1130	2.0796	2.4786
2016-6-12	1.9884	2.3205	0.0000	0.0000	2.0143	2.3866
2016-6-8	1.9990	2.4229	2.6520	1.6422	2.0158	2.431
2016-6-7	2.0254	2.3884	5.1895	2.0126	2.0413	2.5408

活跃 CTD 券情况

		收盘价	加权平均价	涨跌幅
2016-6-13	160010.IB	99.2113	99.2010	-0.2659
	160004.IB	99.1658	99.5411	-0.6971
2016-6-12	160010.IB	99.4758	99.3034	0.4169
	160004.IB	99.8619	99.8627	0.7877

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