



金融期货晨报

日期：2016年6月15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：昨日股票市场缩量震荡，权重板块表现偏弱。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，避险情绪持续释放。昨日晚间中国A股纳入MSCI新兴市场指数被延迟，对市场信心将造成进一步打击，但从SGXA50看，未出现海外资金大举做空的迹象。亚太股市开盘普遍下跌，悲观氛围延续，但国内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：期债继续放量上行，受国内投资回落及国际市场避险情绪影响，银行间利率债收益率加速下行，10年国债收益率今日下行约3BP。TF1609期现价差扩大至0.16，T1609至-0.08，期债价格至前期高点。虽然通胀及投资均有不同程度回落，但基本面整体仍然平稳，期债难以形成趋势性行情，特别是金融降杠杆和政府加杠杆行为将持续制约利率下行空间。短期期债受避险情绪仍会维持偏强，但基本面未发生转变，期债上升空间有限。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	2.3410	2.8440	2.9508	2.9834	3.0500
Tibor	-	0.0164	0.0000	0.0627	0.1127	0.1346
Libor 美元	0.3855	0.4108	0.4421	0.6525	0.9364	1.2593
Libor 英镑	0.4813	0.4863	0.5094	0.5743	0.7166	0.9646
Libor 欧元	-0.3943	-0.3800	-0.3576	-0.2811	-0.1631	-0.0276

全球汇率

	2016-6-14	2016-6-13	2016-6-8	2016-6-7	2016-6-6	2016-6-3
欧元中间价	7.4307	7.4048	7.4503	7.4499	7.4377	7.3347
日元中间价	6.1851	6.1817	6.1207	6.1101	6.1406	6.0431
美元中间价	6.5791	6.5805	6.5593	6.5618	6.5497	6.5793
美元指数	94.9158	94.4217	93.5436	93.8621	94.0234	93.9222
欧元兑美元	1.1207	1.1286	1.1399	1.1356	1.1357	1.1363

各国股市概览

	收盘价	涨跌幅%		收盘价	涨跌幅%
道指	17674.82	-0.325	FTSE100	5923.53	-2.009
标普 500	2075.32	-0.180	日经 225	15859	-1.000
德国 DAX	9519.2	-1.431	上证综指	2842.19	0.322
法国 CAC	4130.33	-2.287	深证成指	9895.15	0.330

国内金融期货前日涨跌

	收盘价	涨跌幅%	持仓量	成交量
IF1606	3050.4	-0.72	20487	15262
IF1609	2948	-0.90	5220	1205
TF1609	100.475	0.14	26814	7623
T1609	99.41	0.26	34168	15554

中债国债到期收益率

	1Y	3Y	5Y	7Y	10Y	15Y
2016-6-14	2.4087	2.5970	2.7818	2.9640	2.9654	3.3447
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

市场资金加权平均利率

	R001. IB	R007. IB	GC001	GC007	IB0001	IB0007
2016-6-14	2.0175	2.3521	2.5274	2.3328	2.0777	2.5171
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	2.4310

活跃 CTD 券情况

		收盘价	加权平均价	涨跌幅
2016-6-14	160010.IB	99.4870	99.3364	0.2779
	160004.IB	99.3733	99.5879	0.2092
2016-6-13	160010.IB	99.2113	99.201	-0.2659
	160004.IB	99.1658	99.5411	-0.6971

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