

 **金融期货晨报**

期 期 : 2016 年 6 月 17 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：昨日股票市场小幅回落，各板块变化不大。近期包括 MSCI 延缓、英国脱欧概率上升、5 月投资数据超预期回落及社融回落，市场对经济的担忧加剧，制约反弹高度，基本面也缺乏有力的利多因素。偏悲观的国内外经济数据及增加的避险情绪压制指数，IF1607 成交仍然低迷，预计 3000 点窄幅震荡。建议观望

国债期货：期债昨日放量拉升，受美联储加息暂缓及次数预期降低影响，国内对资金外流的担忧降低，同时前期投资下滑、社融减少等因素继续发酵。不过宏观经济基本面仍未出现明显变化，短期多头情绪宣泄，市场出现对货币政策过于乐观预期，仍需考虑中期利空因素。银行十年期国债收益率到 2.94%，较前期震荡区间 2.9% 差 4BP，预计 T1609 于 99.9 位置压力增大，若未出现更多利多因素，关注市场情绪，建议于 100 元位置试空。

金融期货主要数据一览

全球利率

	0/N	1W	1M	3M	6M	12M
Shibor	2.0020	2.3430	2.8535	2.9523	2.9834	3.0500
Tibor	-	0.0146	0.0000	0.0618	0.1127	0.1346
Libor 美元	0.3850	0.4100	0.4461	0.6564	0.9429	1.2653
Libor 英镑	0.4813	0.4875	0.5063	0.5719	0.7110	0.9565
Libor 欧元	-0.3943	-0.3814	-0.3590	-0.2826	-0.1646	-0.0340

全球汇率

	2016-6-16	2016-6-15	2016-6-14	2016-6-13	2016-6-8	2016-6-7
欧元中间价	7.4131	7.3975	7.4307	7.4048	7.4503	7.4499
日元中间价	6.2177	6.2298	6.1851	6.1817	6.1207	6.1101
美元中间价	6.5739	6.6001	6.5791	6.5805	6.5593	6.5618
美元指数	94.6095	94.6106	94.9158	94.4217	93.5436	93.8621
欧元兑美元	1.1228	1.1262	1.1207	1.1286	1.1399	1.1356

各国股市概览

	收盘价	涨跌幅%		收盘价	涨跌幅%
道指	17733.1	0.000	FTSE100	5950.48	0.000
标普 500	2077.99	0.000	日经 225	15434.14	0.000
德国 DAX	9550.47	0.000	上证综指	2872.82	-0.499
法国 CAC	4153.01	0.000	深证成指	10115.12	-0.577

国内金融期货前日涨跌

	收盘价	涨跌幅%	持仓量	成交量
IF1606	3088	-0.50	7889	9782
IF1609	2972	-0.99	5723	915
TF1609	100.675	0.19	27026	6250
T1609	99.795	0.33	35954	13358

中债国债到期收益率

	1Y	3Y	5Y	7Y	10Y	15Y
2016-6-16	2.4006	2.5938	2.7612	2.9371	2.9455	3.3248
2016-6-15	2.4071	2.6052	2.7744	2.9599	2.9604	3.3397
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

市场资金加权平均利率

	R001. IB	R007. IB	GC001	GC007	IB0001	IB0007
2016-6-16	2.0235	2.3771	5.1541	2.3224	2.0744	2.4435
2016-6-15	2.0239	2.3831	2.7654	2.5323	2.0589	2.4099
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

活跃 CTD 券情况

		收盘价	加权平均价	涨跌幅
2016-6-16	160010.IB	99.6572	99.5357	0.2137
	160004.IB	99.3283	99.6981	-0.0833
2016-6-15	160010.IB	99.4447	99.458	-0.0425
	160004.IB	99.4111	99.7416	0.0380

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