



金融期货晨报

日期：2016年6月29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：昨日国内股票震荡上行，成交量放大，沪指再次收光头阳线，突破 2900 点。题材全线活跃，个股普涨。外围市场全面企稳，波动性指数（VIX）大幅下降逾 20% 至 18.99，英国公投离开欧盟引发的市场震惊开始消退。政策面上，李克强昨日表示努力维护金融与资本市场稳定。经过长时间的震荡拉锯整理后，沪指在突破 2900 点未出现恐慌杀跌，市场对于后市短期看涨的观点趋于一致，中小创成交量的放大表明部分场外观望资金开始进场，题材股表现抢眼。建议短多操作。

国债期货：期债高开回落，成交量放大，昨日上午国开债招标，10 年期收益率 3.1546% 低于二级市场约 3BP，但期债掉头翻绿，午后 13.30 分减仓加速下跌。在两个交易日的拉升后多头信心不足，英国脱欧产生的恐慌性情绪并未在国内市场发酵，李克强连续两日的表态显示出政府财政政策有望进一步扩张，同时避免大水漫灌，货币政策维持稳健，无降准降息必要条件。短期期债仍有上行动力，但空间极为有限，市场重新关注基本面情况。建议短空尝试。



金融期货主要数据一览

全球利率

| | 0/N | 1W | 1M | 3M | 6M | 12M |
|----------|---------|---------|---------|---------|---------|---------|
| Shibor | 2.0400 | 2.3810 | 2.8899 | 2.9638 | 2.9845 | 3.0510 |
| Tibor | - | 0.0146 | 0.0000 | 0.0618 | 0.1118 | 0.1336 |
| Libor 美元 | 0.4001 | 0.4320 | 0.4588 | 0.6271 | 0.8869 | 1.1957 |
| Libor 英镑 | 0.4788 | 0.4846 | 0.4994 | 0.5484 | 0.6560 | 0.8978 |
| Libor 欧元 | -0.3971 | -0.3829 | -0.3614 | -0.2974 | -0.1856 | -0.0594 |

全球汇率

| | 2016-6-28 | 2016-6-27 | 2016-6-24 | 2016-6-23 | 2016-6-22 | 2016-6-21 |
|-------|-----------|-----------|-----------|-----------|-----------|-----------|
| 欧元中间价 | 7.3238 | 7.3184 | 7.4434 | 7.4447 | 7.4087 | 7.4393 |
| 日元中间价 | 6.53 | 6.5042 | 6.2725 | 6.27 | 6.2949 | 6.3223 |
| 美元中间价 | 6.6528 | 6.6375 | 6.5776 | 6.5658 | 6.5935 | 6.5656 |
| 美元指数 | 96.0549 | 96.3817 | 95.4392 | 93.0873 | 93.5461 | 94.069 |
| 欧元兑美元 | 1.1076 | 1.1021 | 1.1115 | 1.1421 | 1.1333 | 1.1249 |

各国股市概览

| | 收盘价 | 涨跌幅% | | 收盘价 | 涨跌幅% |
|--------|----------|-------|---------|----------|-------|
| 道指 | 17409.72 | 1.572 | FTSE100 | 6140.39 | 2.644 |
| 标普 500 | 2036.09 | 1.777 | 日经 225 | 15323.14 | 0.091 |
| 德国 DAX | 9447.28 | 1.927 | 上证综指 | 2912.56 | 0.582 |
| 法国 CAC | 4088.85 | 2.613 | 深证成指 | 10463.45 | 0.828 |

国内金融期货前日涨跌

| | 收盘价 | 涨跌幅% | 持仓量 | 成交量 |
|--------|--------|-------|-------|-------|
| IF1607 | 3094 | 0.69 | 30846 | 12662 |
| IF1609 | 3032.8 | 0.74 | 6495 | 885 |
| TF1609 | 100.86 | -0.19 | 27346 | 8576 |
| T1609 | 100.14 | -0.30 | 31279 | 18030 |

中债国债到期收益率

| | 1Y | 3Y | 5Y | 7Y | 10Y | 15Y |
|-----------|--------|--------|--------|--------|--------|--------|
| 2016-6-28 | 2.3917 | 2.5567 | 2.6856 | 2.8650 | 2.8610 | 3.3499 |
| 2016-6-27 | 2.3985 | 2.5427 | 2.6726 | 2.8400 | 2.8310 | 3.3399 |
| 2016-6-24 | 2.4005 | 2.5678 | 2.7079 | 2.8801 | 2.8808 | 3.3429 |
| 2016-6-23 | 2.3979 | 2.5827 | 2.7497 | 2.9202 | 2.9307 | 3.3304 |

市场资金加权平均利率

| | R001. IB | R007. IB | GC001 | GC007 | IB0001 | IB0007 |
|-----------|----------|----------|--------|--------|--------|--------|
| 2016-6-28 | 2.0464 | 2.7590 | 4.8582 | 4.0908 | 2.0872 | 2.5495 |
| 2016-6-27 | 2.0456 | 2.6241 | 3.6797 | 3.4199 | 2.0726 | 2.4996 |
| 2016-6-24 | 2.0493 | 2.5457 | 2.8907 | 2.8656 | 2.0791 | 2.5452 |
| 2016-6-23 | 2.0457 | 2.4535 | 4.4798 | 2.5271 | 2.0858 | 2.4173 |

活跃 CTD 券情况

| | | 收盘价 | 加权平均价 | 涨跌幅 |
|-----------|-----------|----------|----------|---------|
| 2016-6-28 | 160010.IB | 100.5960 | 100.3654 | -0.0853 |
| | 160004.IB | 99.7490 | 99.9199 | -0.3742 |
| 2016-6-27 | 160010.IB | 100.6819 | 100.121 | 0.5982 |
| | 160004.IB | 100.1237 | 99.9478 | 0.2922 |

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 |