

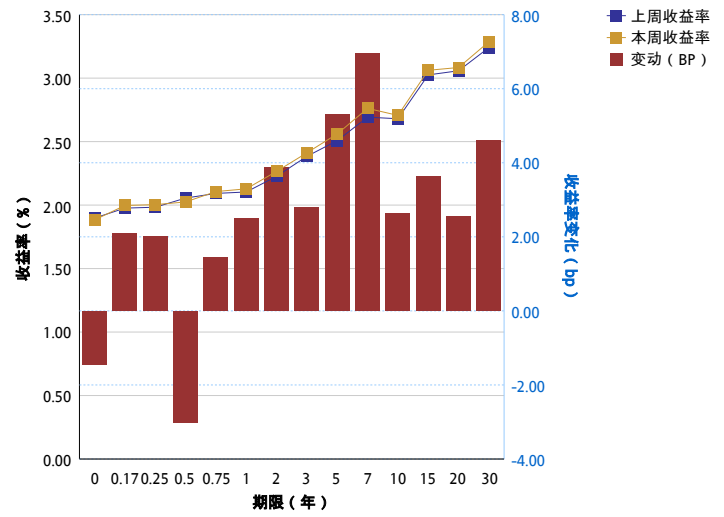
指数20160822--20160829

指数名称	指标名称	20160829	20160822	变化率(%)	上涨点数
中债-央票总指数	净价指数	102.3785	102.4054	-0.03	-0.0269
中债-央票总指数	平均市值法久期	0.0619	0.0597	3.69	0.0022
中债-央票总指数	财富指数	153.6301	153.5697	0.04	0.0604
中债-综合指数	净价指数	104.9320	105.1032	-0.16	-0.1712
中债-综合指数	平均市值法久期	4.0447	4.0314	0.33	0.0133
中债-综合指数	财富指数	179.3161	179.4604	-0.08	-0.1443

收益率曲线变动情况20160822-20160829

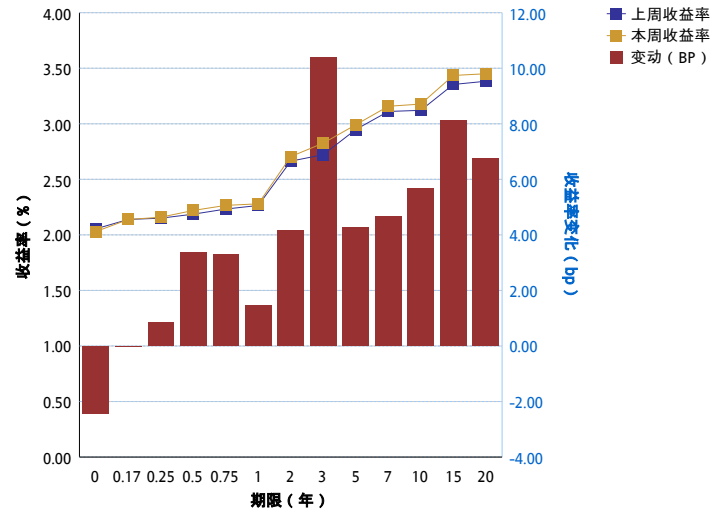
1.中债国债收益率曲线关键期限比较

期限 (年)	20160822	20160829	变动 (bp)
0.00	1.8979	1.8835	-1.44
0.17	1.9761	1.9970	2.10
0.25	1.9833	2.0035	2.02
0.50	2.0552	2.0250	-3.02
0.75	2.0920	2.1065	1.46
1.00	2.1032	2.1282	2.50
2.00	2.2269	2.2655	3.87
3.00	2.3841	2.4120	2.79
5.00	2.5079	2.5611	5.32
7.00	2.6925	2.7619	6.94
10.00	2.6801	2.7064	2.63
15.00	3.0256	3.0618	3.62
20.00	3.0581	3.0837	2.56
30.00	3.2408	3.2867	4.59
平均	2.4231	2.4488	2.57



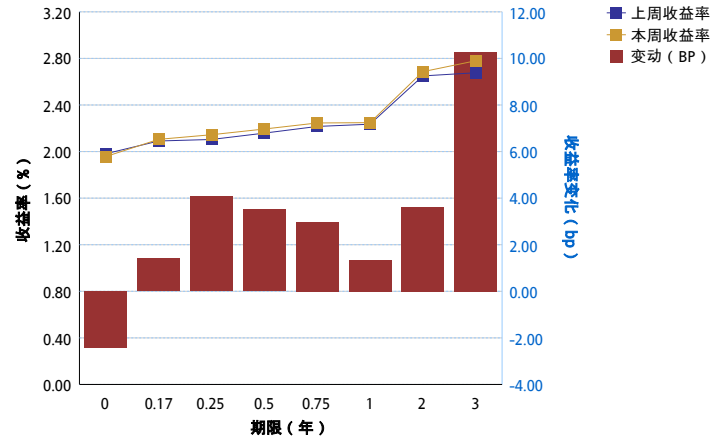
2.政策性银行债收益率曲线关键期限点比较

期限 (年)	20160822	20160829	变动 (bp)
0.00	2.0540	2.0297	-2.43
0.17	2.1388	2.1386	-0.02
0.25	2.1504	2.1590	0.86
0.50	2.1864	2.2199	3.35
0.75	2.2325	2.2656	3.30
1.00	2.2648	2.2794	1.46
2.00	2.6636	2.7050	4.14
3.00	2.7221	2.8261	10.40
5.00	2.9485	2.9913	4.28
7.00	3.1111	3.1576	4.65
10.00	3.1210	3.1776	5.66
15.00	3.3541	3.4351	8.10
20.00	3.3829	3.4503	6.74
平均	2.6408	2.6796	3.88



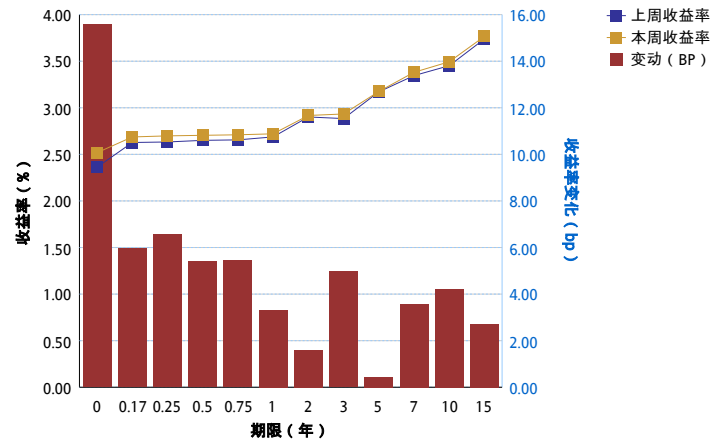
3.央票收益率曲线关键期限点比较

期限 (年)	20160822	20160829	变动 (bp)
0.00	1.9816	1.9573	-2.43
0.17	2.0909	2.1050	1.42
0.25	2.1039	2.1446	4.07
0.50	2.1585	2.1937	3.52
0.75	2.2158	2.2455	2.97
1.00	2.2350	2.2485	1.35
2.00	2.6497	2.6859	3.62
3.00	2.6768	2.7795	10.27
平均	2.2640	2.2950	3.10



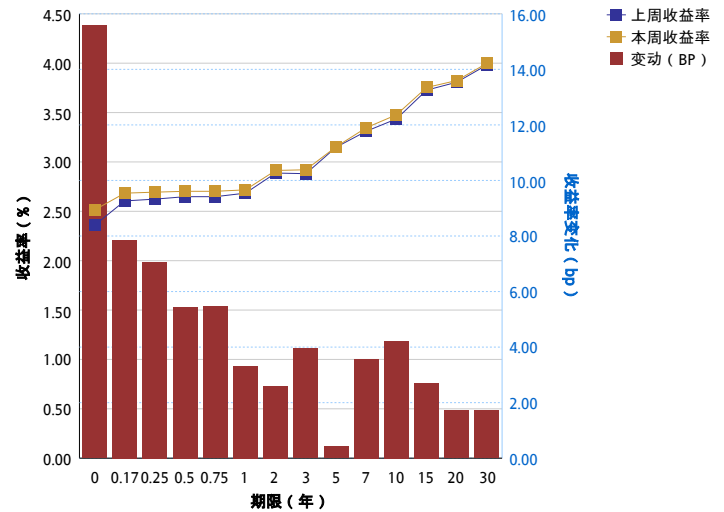
4.AAA中短期票据收益率曲线关键期限点比较

期限 (年)	20160822	20160829	变动 (bp)
0.00	2.3622	2.5179	15.57
0.17	2.6273	2.6870	5.97
0.25	2.6330	2.6986	6.56
0.50	2.6504	2.7044	5.40
0.75	2.6555	2.7100	5.45
1.00	2.6873	2.7206	3.33
2.00	2.9014	2.9174	1.60
3.00	2.8840	2.9336	4.96
5.00	3.1707	3.1750	0.43
7.00	3.3455	3.3812	3.57
10.00	3.4517	3.4938	4.21
15.00	3.7396	3.7666	2.71
平均	2.9257	2.9755	4.98



5.AAA企业债收益率曲线关键期限点比较

期限 (年)	20160822	20160829	变动 (bp)
0.00	2.3584	2.5141	15.57
0.17	2.6054	2.6840	7.86
0.25	2.6234	2.6940	7.06
0.50	2.6481	2.7026	5.45
0.75	2.6482	2.7027	5.45
1.00	2.6841	2.7174	3.33
2.00	2.8876	2.9136	2.60
3.00	2.8811	2.9207	3.96
5.00	3.1488	3.1531	0.43
7.00	3.3109	3.3466	3.57
10.00	3.4355	3.4776	4.22
15.00	3.7271	3.7541	2.71
20.00	3.8075	3.8246	1.71
30.00	3.9823	3.9994	1.71
平均	3.0535	3.1003	4.69



市场交易概览20160822--20160829

序号	业务类别	本周结算面额 (亿元)	结算面额较上周涨跌幅 (%)	本周笔数	笔数较上周涨跌幅 (%)
1	现券交易	11,057.48	-8.17	13,625	-1.46
2	质押式回购	53,590.09	-25.54	12,559	-15.11
3	买断式回购	2,658.64	-23.97	2,725	-18.17
4	远期交割	-	-	-	-
5	债券借贷	140.32	39.96	88	46.67
汇总		67,446.53	-4.43	28,997	2.98

现券交易情况20160822--20160829

债券类别	本周结算面额 (亿元)	结算面额较上周涨跌幅 (%)	本周笔数	笔数较上周涨跌幅 (%)
中央企业债	13.00	106.35	22	57.14
中期票据	143.55	10.55	188	5.03
二级资本工具	2.45	-71.18	6	-60.00
保险公司金融债	0.40	-93.33	2	-33.33
商业银行债券	182.17	1.41	90	-10.00
地方企业债	733.37	5.95	1,287	-0.08
地方政府债	237.20	-10.36	120	4.35
扶贫专项金融债	32.10	7.00	10	66.67
政府支持机构债	38.22	-4.45	61	-1.61
政策性银行债券	7,463.38	-11.12	9,339	-1.97
记账式国债	2,142.72	-3.99	2,447	0.33
资产支持证券	25.42	4.10	19	-34.48
集合企业债	1.20	50.00	2	0.00
非银行金融机构债	26.50	960.00	19	280.00
项目收益债券	15.80	-42.55	13	-69.77
合计	11,057.48	60.56	13,625	13.49

质押式回购交易情况20160822--20160829

交易期限品种	正回购金额 (亿元)	正回购笔数	利率 (最小)	利率 (最大)	利率 (平均)
R01D	30,622.49	6,315	0.0180	0.0330	0.0212
R01M	52.96	18	0.0235	0.0330	0.0290
R02D	48.53	29	0.0200	0.0260	0.0228
R02M	111.20	25	0.0260	0.0315	0.0281
R03D	15,135.31	3,059	0.0175	0.0300	0.0210
R03M	20.56	12	0.0275	0.0350	0.0291
R04M	18.00	2	0.0270	0.0270	0.0270
R07D	6,705.53	2,619	0.0185	0.0400	0.0260
R14D	862.49	465	0.0240	0.0350	0.0302
R21D	13.02	15	0.0265	0.0345	0.0313
合计	53,590.09	12,559	0.0175	0.0400	0.0266