

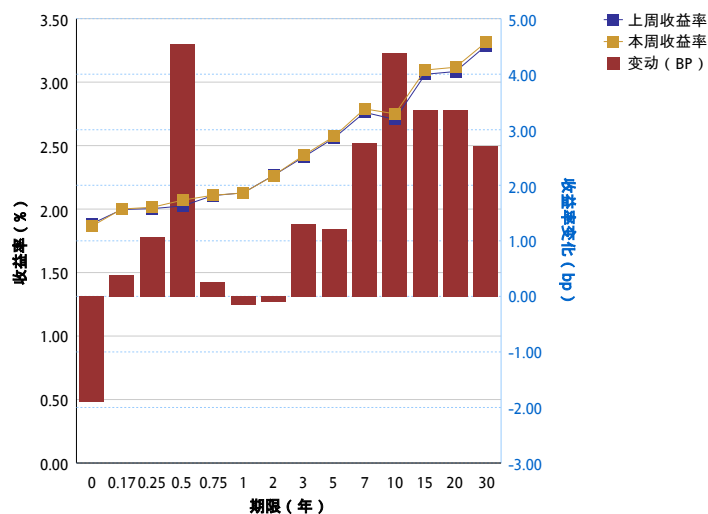
指数20160829--20160905

指数名称	指标名称	20160905	20160829	变化率(%)	上涨点数
中债-央票总指数	净价指数	102.3465	102.3785	-0.03	-0.0320
中债-央票总指数	平均市值法久期	0.0428	0.0619	-30.86	-0.0191
中债-央票总指数	财富指数	153.6832	153.6301	0.03	0.0531
中债-综合指数	净价指数	104.8130	104.9320	-0.11	-0.1190
中债-综合指数	平均市值法久期	4.0426	4.0447	-0.05	-0.0021
中债-综合指数	财富指数	179.2634	179.3161	-0.03	-0.0527

收益率曲线变动情况20160829-20160905

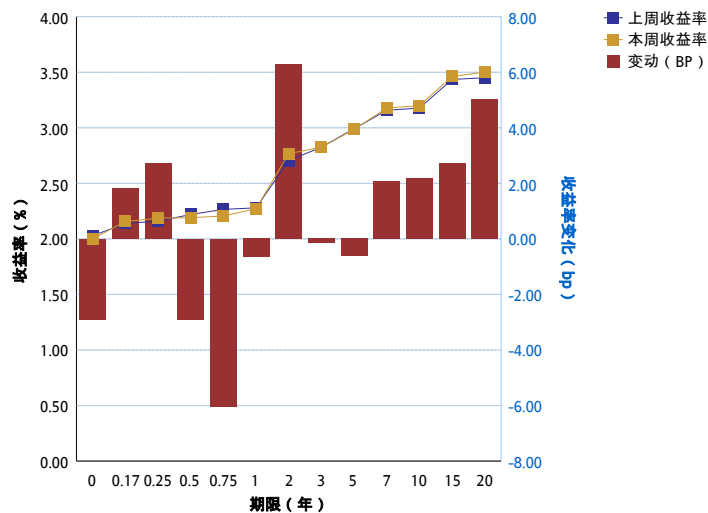
1.中债国债收益率曲线关键期限比较

期限 (年)	20160829	20160905	变动 (bp)
0.00	1.8835	1.8645	-1.90
0.17	1.9970	2.0009	0.39
0.25	2.0035	2.0142	1.07
0.50	2.0250	2.0704	4.54
0.75	2.1065	2.1092	0.26
1.00	2.1282	2.1267	-0.15
2.00	2.2655	2.2646	-0.10
3.00	2.4120	2.4250	1.30
5.00	2.5611	2.5733	1.22
7.00	2.7619	2.7895	2.76
10.00	2.7064	2.7503	4.38
15.00	3.0618	3.0954	3.36
20.00	3.0837	3.1173	3.36
30.00	3.2867	3.3137	2.71
平均	2.4488	2.4653	1.66



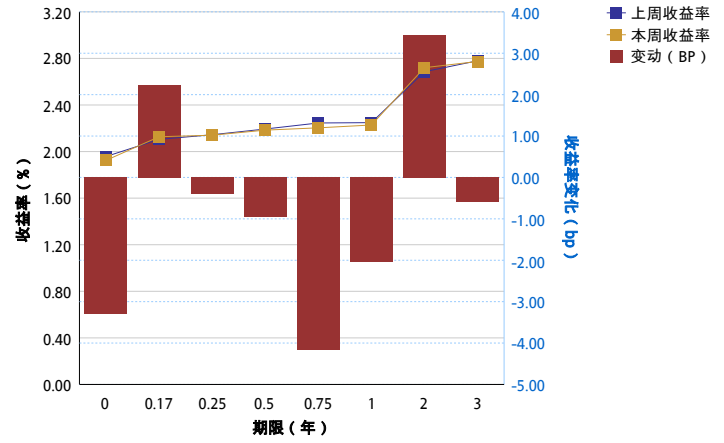
2.政策性银行债收益率曲线关键期限点比较

期限 (年)	20160829	20160905	变动 (bp)
0.00	2.0297	2.0007	-2.90
0.17	2.1386	2.1566	1.80
0.25	2.1590	2.1863	2.73
0.50	2.2199	2.1910	-2.89
0.75	2.2656	2.2052	-6.03
1.00	2.2794	2.2729	-0.65
2.00	2.7050	2.7679	6.29
3.00	2.8261	2.8246	-0.14
5.00	2.9913	2.9851	-0.61
7.00	3.1576	3.1783	2.08
10.00	3.1776	3.1995	2.20
15.00	3.4351	3.4622	2.71
20.00	3.4503	3.5006	5.03
平均	2.6796	2.6870	0.74



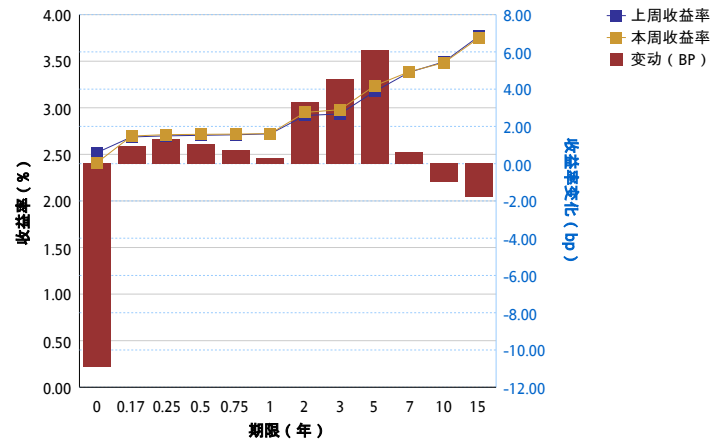
3.央票收益率曲线关键期限点比较

期限 (年)	20160829	20160905	变动 (bp)
0.00	1.9573	1.9243	-3.30
0.17	2.1050	2.1273	2.23
0.25	2.1446	2.1405	-0.41
0.50	2.1937	2.1841	-0.96
0.75	2.2455	2.2039	-4.16
1.00	2.2485	2.2280	-2.05
2.00	2.6859	2.7204	3.45
3.00	2.7795	2.7735	-0.60
平均	2.2950	2.2878	-0.72



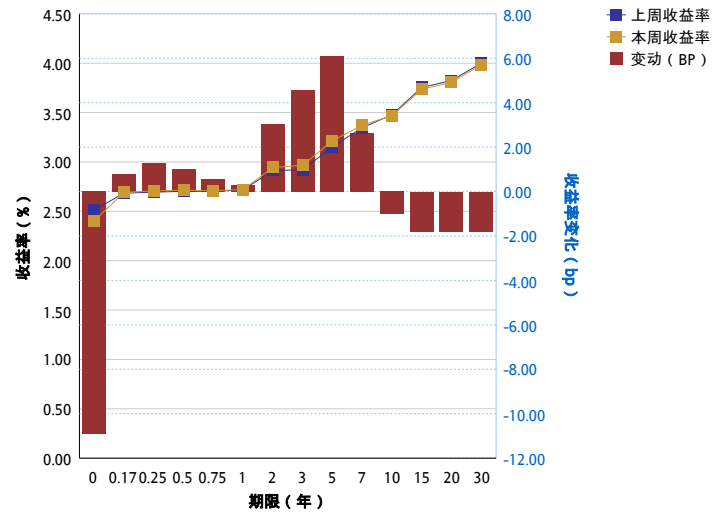
4.AAA中短期票据收益率曲线关键期限点比较

期限 (年)	20160829	20160905	变动 (bp)
0.00	2.5179	2.4089	-10.90
0.17	2.6870	2.6965	0.95
0.25	2.6986	2.7118	1.32
0.50	2.7044	2.7149	1.05
0.75	2.7100	2.7174	0.74
1.00	2.7206	2.7236	0.30
2.00	2.9174	2.9506	3.32
3.00	2.9336	2.9792	4.56
5.00	3.1750	3.2359	6.09
7.00	3.3812	3.3874	0.62
10.00	3.4938	3.4838	-1.00
15.00	3.7666	3.7487	-1.80
平均	2.9755	2.9799	0.44



5.AAA企业债收益率曲线关键期限点比较

期限 (年)	20160829	20160905	变动 (bp)
0.00	2.5141	2.4051	-10.90
0.17	2.6840	2.6920	0.80
0.25	2.6940	2.7068	1.28
0.50	2.7026	2.7129	1.03
0.75	2.7027	2.7083	0.56
1.00	2.7174	2.7204	0.30
2.00	2.9136	2.9439	3.03
3.00	2.9207	2.9663	4.56
5.00	3.1531	3.2140	6.09
7.00	3.3466	3.3728	2.62
10.00	3.4776	3.4676	-1.00
15.00	3.7541	3.7361	-1.80
20.00	3.8246	3.8066	-1.80
30.00	3.9994	3.9814	-1.80
平均	3.1003	3.1024	0.21



市场交易概览20160829--20160905

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	11,071.53	0.13	11,604	-14.83
2	质押式回购	65,487.22	22.20	13,271	5.67
3	买断式回购	2,837.74	6.74	2,617	-3.96
4	远期交割	-	-	-	-
5	债券借贷	124.52	-11.26	82	-6.82
汇总		79,521.02	4.45	27,574	-4.99

现券交易情况20160829--20160905

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	10.80	-16.92	8	-63.64
中期票据	138.84	-3.28	201	6.91
二级资本工具	1.90	-22.45	3	-50.00
保险公司金融债	8.80	2,100.00	5	150.00
商业银行债券	165.61	-9.09	83	-7.78
地方企业债	724.10	-1.26	1,290	0.23
地方政府债	262.80	10.79	106	-11.67
央行票据	2.00	-	1	-
扶贫专项金融债	31.00	-3.43	7	-30.00
政府支持机构债	47.00	22.97	32	-47.54
政策性银行债券	7,784.85	4.31	8,013	-14.20
记账式国债	1,825.09	-14.82	1,774	-27.50
资产支持证券	27.74	9.13	29	52.63
集合企业债	2.00	66.67	2	0.00
非银行金融机构债	15.80	-40.38	22	15.79
项目收益债券	23.20	46.84	28	115.38
合计	11,071.53	143.27	11,604	5.91

质押式回购交易情况20160829--20160905

交易期限品种	正回购面额 (亿元)	正回购笔数	利率 (最小)	利率 (最大)	利率 (平均)
R01D	40,052.68	7,268	0.0170	0.0275	0.0210
R01M	0.50	1	0.0260	0.0260	0.0260
R01Y	2.00	1	0.0310	0.0310	0.0310
R02D	25.34	19	0.0210	0.0270	0.0239
R02M	94.68	51	0.0260	0.0350	0.0289
R03D	20,348.37	3,677	0.0180	0.0300	0.0210
R03M	223.46	16	0.0270	0.0310	0.0281
R04M	1.20	2	0.0276	0.0350	0.0313
R06M	8.09	8	0.0300	0.0315	0.0305
R07D	4,263.03	1,998	0.0200	0.0280	0.0243
R09M	2.00	1	0.0310	0.0310	0.0310
R14D	197.70	118	0.0228	0.0280	0.0250
R21D	268.17	111	0.0240	0.0280	0.0256
合计	65,487.22	13,271	0.0170	0.0350	0.0267