

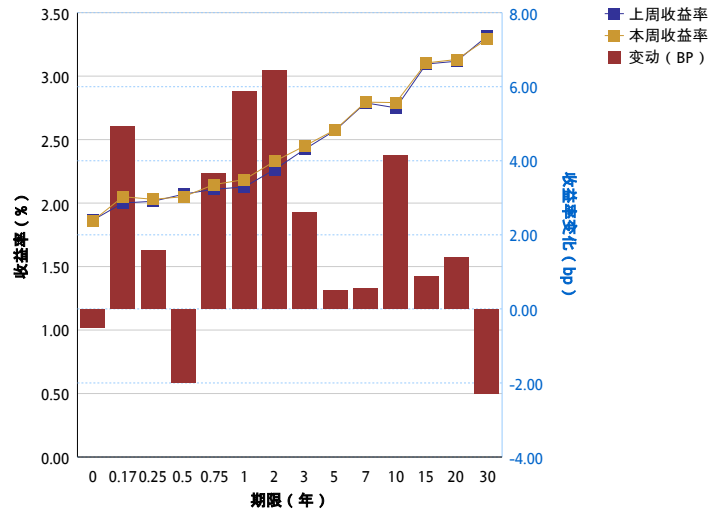
指数20160905--20160912

指数名称	指标名称	20160912	20160905	变化率(%)	上涨点数
中债-央票总指数	净价指数	102.3251	102.3465	-0.02	-0.0214
中债-央票总指数	平均市值法久期	0.1183	0.0428	176.40	0.0755
中债-央票总指数	财富指数	153.7515	153.6832	0.04	0.0683
中债-综合指数	净价指数	104.7754	104.8130	-0.04	-0.0376
中债-综合指数	平均市值法久期	4.0573	4.0426	0.36	0.0147
中债-综合指数	财富指数	179.3489	179.2634	0.05	0.0855

收益率曲线变动情况20160905-20160912

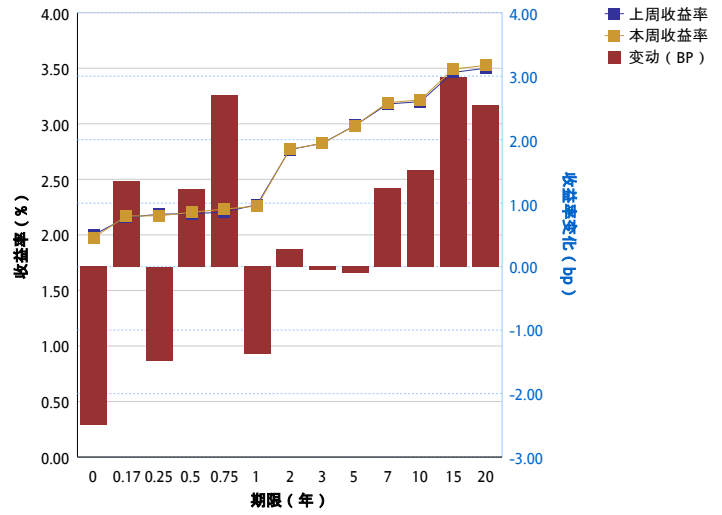
1.中债国债收益率曲线关键期限比较

期限 (年)	20160905	20160912	变动 (bp)
0.00	1.8645	1.8595	-0.50
0.17	2.0009	2.0501	4.92
0.25	2.0142	2.0299	1.57
0.50	2.0704	2.0506	-1.98
0.75	2.1092	2.1457	3.66
1.00	2.1267	2.1854	5.88
2.00	2.2646	2.3290	6.45
3.00	2.4250	2.4511	2.61
5.00	2.5733	2.5782	0.49
7.00	2.7895	2.7950	0.55
10.00	2.7503	2.7916	4.13
15.00	3.0954	3.1042	0.88
20.00	3.1173	3.1311	1.38
30.00	3.3137	3.2909	-2.28
平均	2.4653	2.4852	1.98



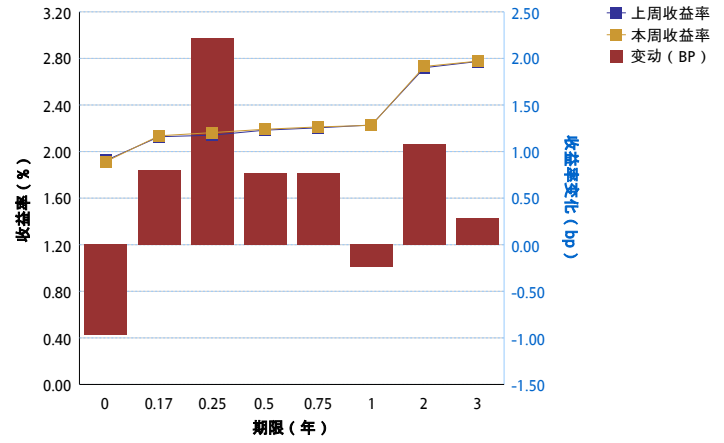
2.政策性银行债收益率曲线关键期限点比较

期限 (年)	20160905	20160912	变动 (bp)
0.00	2.0007	1.9757	-2.50
0.17	2.1566	2.1701	1.35
0.25	2.1863	2.1715	-1.48
0.50	2.1910	2.2033	1.23
0.75	2.2052	2.2323	2.71
1.00	2.2729	2.2591	-1.38
2.00	2.7679	2.7706	0.28
3.00	2.8246	2.8240	-0.06
5.00	2.9851	2.9841	-0.10
7.00	3.1783	3.1907	1.24
10.00	3.1995	3.2148	1.52
15.00	3.4622	3.4920	2.98
20.00	3.5006	3.5261	2.55
平均	2.6870	2.6934	0.64



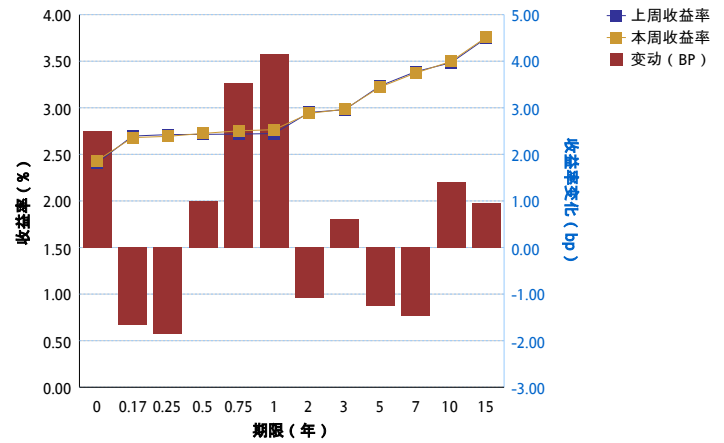
3.央票收益率曲线关键期限点比较

期限 (年)	20160905	20160912	变动 (bp)
0.00	1.9243	1.9146	-0.97
0.17	2.1273	2.1354	0.80
0.25	2.1405	2.1628	2.22
0.50	2.1841	2.1918	0.77
0.75	2.2039	2.2116	0.76
1.00	2.2280	2.2256	-0.24
2.00	2.7204	2.7311	1.07
3.00	2.7735	2.7763	0.28
平均	2.2878	2.2936	0.59



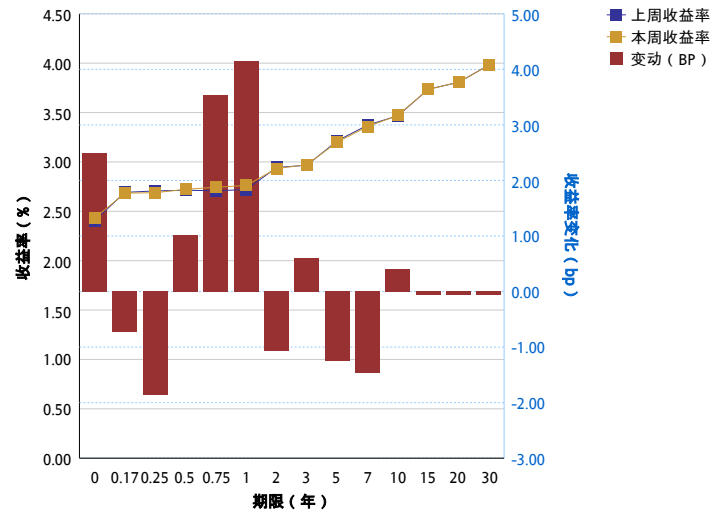
4.AAA中短期票据收益率曲线关键期限点比较

期限 (年)	20160905	20160912	变动 (bp)
0.00	2.4089	2.4339	2.50
0.17	2.6965	2.6798	-1.67
0.25	2.7118	2.6932	-1.86
0.50	2.7149	2.7250	1.01
0.75	2.7174	2.7527	3.53
1.00	2.7236	2.7651	4.15
2.00	2.9506	2.9399	-1.08
3.00	2.9792	2.9852	0.61
5.00	3.2359	3.2233	-1.26
7.00	3.3874	3.3728	-1.47
10.00	3.4838	3.4979	1.41
15.00	3.7487	3.7581	0.94
平均	2.9799	2.9856	0.57



5.AAA企业债收益率曲线关键期限点比较

期限 (年)	20160905	20160912	变动 (bp)
0.00	2.4051	2.4301	2.50
0.17	2.6920	2.6847	-0.72
0.25	2.7068	2.6882	-1.86
0.50	2.7129	2.7230	1.01
0.75	2.7083	2.7436	3.53
1.00	2.7204	2.7619	4.15
2.00	2.9439	2.9332	-1.08
3.00	2.9663	2.9723	0.60
5.00	3.2140	3.2014	-1.26
7.00	3.3728	3.3582	-1.47
10.00	3.4676	3.4716	0.40
15.00	3.7361	3.7355	-0.06
20.00	3.8066	3.8061	-0.06
30.00	3.9814	3.9808	-0.06
平均	3.1024	3.1065	0.40



市场交易概览20160905--20160912

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	11,780.97	6.41	11,403	-1.73
2	质押式回购	70,834.91	8.17	14,483	9.13
3	买断式回购	3,158.13	11.29	2,902	10.89
4	远期交割	-	-	-	-
5	债券借贷	224.42	80.23	79	-3.66
汇总		85,998.43	26.52	28,867	3.66

现券交易情况20160905--20160912

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	5.60	-48.15	10	25.00
中期票据	144.45	4.04	220	9.45
二级资本工具	2.08	9.47	3	0.00
保险公司金融债	4.40	-50.00	4	-20.00
商业银行债券	179.55	8.42	99	19.28
地方企业债	769.53	6.27	1,492	15.66
地方政府债	400.64	52.45	172	62.26
扶贫专项金融债	30.00	-3.23	6	-14.29
政府支持机构债	25.53	-45.68	28	-12.50
政策性银行债券	7,922.43	1.77	7,215	-9.96
记账式国债	2,247.89	23.17	2,100	18.38
资产支持证券	4.28	-84.57	8	-72.41
集合企业债	2.90	45.00	6	200.00
非银行金融机构债	9.00	-43.04	5	-77.27
项目收益债券	32.70	40.95	35	25.00
合计	11,780.97	-5.54	11,403	11.24

质押式回购交易情况20160905--20160912

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	42,254.51	7,583	0.0185	0.0320	0.0215
R01M	188.66	75	0.0260	0.0330	0.0285
R02D	26.99	32	0.0210	0.0272	0.0240
R02M	97.64	64	0.0264	0.0330	0.0295
R03D	20,925.51	3,777	0.0185	0.0300	0.0213
R03M	149.73	28	0.0268	0.0340	0.0290
R06M	2.00	2	0.0300	0.0303	0.0301
R07D	3,314.63	1,328	0.0200	0.0315	0.0244
R14D	3,851.04	1,570	0.0220	0.0285	0.0247
R21D	24.20	24	0.0228	0.0270	0.0261
合计	70,834.91	14,483	0.0185	0.0340	0.0259