

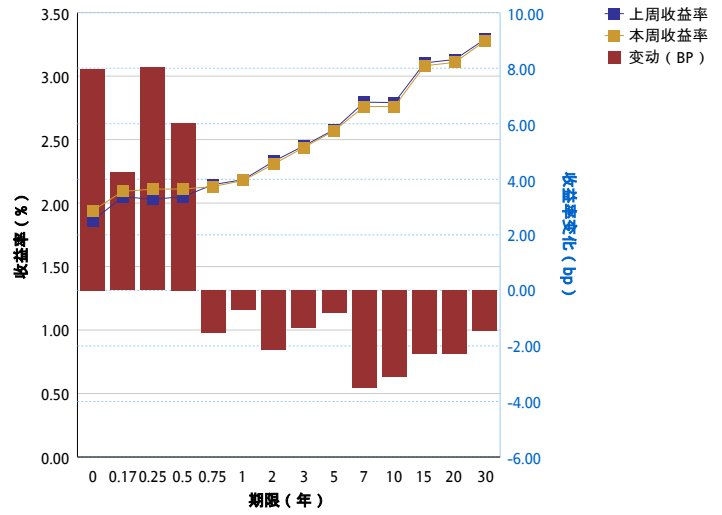
指数20160912--20160919

指数名称	指标名称	20160919	20160912	变化率(%)	上涨点数
中债-央票总指数	净价指数	102.2946	102.3251	-0.03	-0.0305
中债-央票总指数	平均市值法久期	0.0992	0.1183	-16.15	-0.0191
中债-央票总指数	财富指数	153.8068	153.7515	0.04	0.0553
中债-综合指数	净价指数	104.8292	104.7754	0.05	0.0538
中债-综合指数	平均市值法久期	4.0536	4.0573	-0.09	-0.0037
中债-综合指数	财富指数	179.5876	179.3489	0.13	0.2387

收益率曲线变动情况20160912-20160919

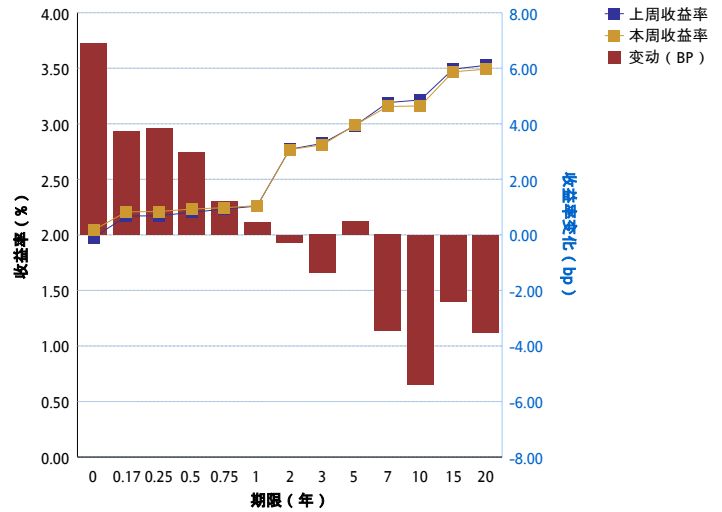
1.中债国债收益率曲线关键期限比较

期限 (年)	20160912	20160919	变动 (bp)
0.00	1.8595	1.9392	7.97
0.17	2.0501	2.0925	4.25
0.25	2.0299	2.1101	8.02
0.50	2.0506	2.1109	6.02
0.75	2.1457	2.1304	-1.53
1.00	2.1854	2.1784	-0.70
2.00	2.3290	2.3076	-2.14
3.00	2.4511	2.4376	-1.34
5.00	2.5782	2.5699	-0.82
7.00	2.7950	2.7600	-3.50
10.00	2.7916	2.7605	-3.11
15.00	3.1042	3.0814	-2.28
20.00	3.1311	3.1083	-2.28
30.00	3.2909	3.2763	-1.46
平均	2.4852	2.4902	0.51



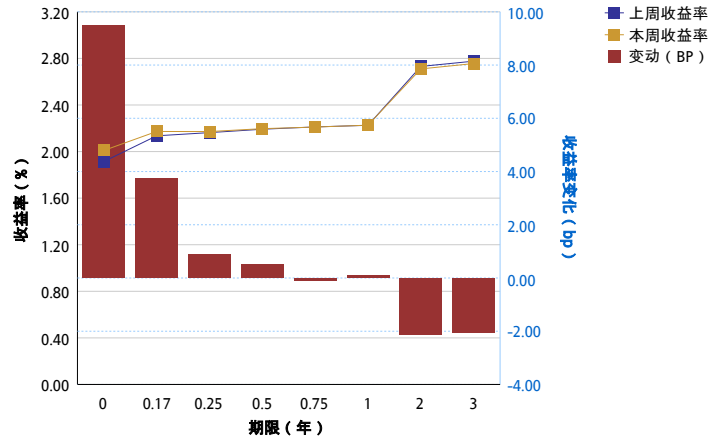
2.政策性银行债收益率曲线关键期限点比较

期限 (年)	20160912	20160919	变动 (bp)
0.00	1.9757	2.0447	6.90
0.17	2.1701	2.2072	3.71
0.25	2.1715	2.2100	3.85
0.50	2.2033	2.2329	2.96
0.75	2.2323	2.2444	1.21
1.00	2.2591	2.2634	0.43
2.00	2.7706	2.7679	-0.27
3.00	2.8240	2.8103	-1.38
5.00	2.9841	2.9890	0.49
7.00	3.1907	3.1561	-3.46
10.00	3.2148	3.1608	-5.40
15.00	3.4920	3.4680	-2.40
20.00	3.5261	3.4910	-3.51
平均	2.6934	2.6958	0.24



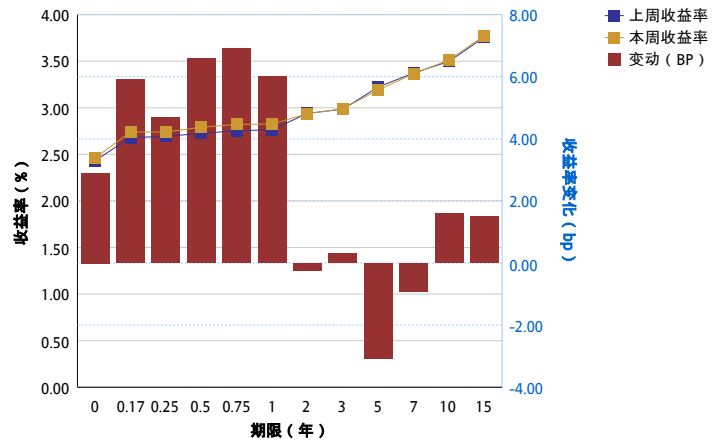
3.央票收益率曲线关键期限点比较

期限 (年)	20160912	20160919	变动 (bp)
0.00	1.9146	2.0096	9.50
0.17	2.1354	2.1726	3.72
0.25	2.1628	2.1718	0.90
0.50	2.1918	2.1967	0.49
0.75	2.2116	2.2104	-0.11
1.00	2.2256	2.2266	0.10
2.00	2.7311	2.7099	-2.13
3.00	2.7763	2.7557	-2.06
平均	2.2936	2.3067	1.30



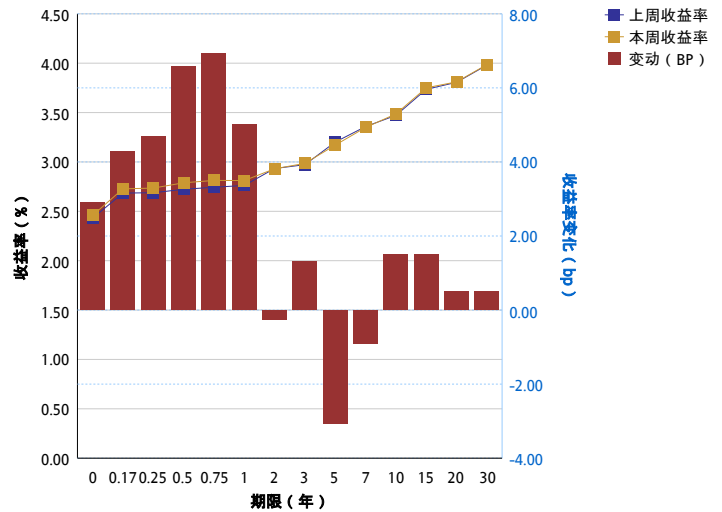
4.AAA中期票据收益率曲线关键期限点比较

期限 (年)	20160912	20160919	变动 (bp)
0.00	2.4339	2.4629	2.90
0.17	2.6798	2.7387	5.90
0.25	2.6932	2.7401	4.69
0.50	2.7250	2.7908	6.58
0.75	2.7527	2.8219	6.92
1.00	2.7651	2.8251	6.00
2.00	2.9399	2.9374	-0.25
3.00	2.9852	2.9885	0.32
5.00	3.2233	3.1926	-3.07
7.00	3.3728	3.3636	-0.92
10.00	3.4979	3.5139	1.60
15.00	3.7581	3.7730	1.49
平均	2.9856	3.0124	2.68



5.AAA企业债收益率曲线关键期限点比较

期限 (年)	20160912	20160919	变动 (bp)
0.00	2.4301	2.4591	2.90
0.17	2.6847	2.7276	4.29
0.25	2.6882	2.7351	4.69
0.50	2.7230	2.7888	6.58
0.75	2.7436	2.8128	6.92
1.00	2.7619	2.8119	5.00
2.00	2.9332	2.9306	-0.25
3.00	2.9723	2.9855	1.32
5.00	3.2014	3.1707	-3.07
7.00	3.3582	3.3490	-0.92
10.00	3.4716	3.4866	1.50
15.00	3.7355	3.7504	1.49
20.00	3.8061	3.8110	0.49
30.00	3.9808	3.9857	0.49
平均	3.1065	3.1289	2.24



市场交易概览20160912--20160919

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	4,138.56	-64.87	3,299	-71.07
2	质押式回购	33,229.21	-53.09	7,418	-48.78
3	买断式回购	920.00	-70.87	902	-68.92
4	远期交割	-	-	-	-
5	债券借贷	254.25	13.29	43	-45.57
汇总		38,542.01	-43.88	11,662	-58.58

现券交易情况20160912--20160919

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 (%)
中期票据	25.08	-82.64	43	-80.45
二级资本工具	2.80	34.62	4	33.33
商业银行债券	51.78	-71.16	30	-69.70
地方企业债	202.42	-73.69	402	-73.06
地方政府债	207.40	-48.23	61	-64.53
扶贫专项金融债	44.00	46.67	8	33.33
政府支持机构债	20.10	-21.28	31	10.71
政策性银行债券	3,039.65	-61.63	2,239	-68.97
记账式国债	541.90	-75.89	466	-77.81
资产支持证券	0.62	-85.51	12	50.00
非银行金融机构债	2.00	-77.78	1	-80.00
项目收益债券	0.80	-97.55	2	-94.29
合计	4,138.56	-51.17	3,299	-40.12

质押式回购交易情况20160912--20160919

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	27,348.49	5,383	0.0200	0.0310	0.0229
R01M	335.68	144	0.0262	0.0380	0.0300
R02D	140.76	66	0.0210	0.0330	0.0261
R02M	11.52	7	0.0300	0.0340	0.0316
R03D	29.31	23	0.0215	0.0310	0.0269
R03M	138.37	25	0.0276	0.0333	0.0293
R04M	1.00	1	0.0280	0.0280	0.0280
R06M	0.60	1	0.0315	0.0315	0.0315
R07D	2,749.70	1,002	0.0225	0.0350	0.0273
R09M	1.00	1	0.0320	0.0320	0.0320
R14D	1,196.58	414	0.0225	0.0350	0.0260
R21D	1,276.20	351	0.0248	0.0350	0.0298
合计	33,229.21	7,418	0.0200	0.0380	0.0284