

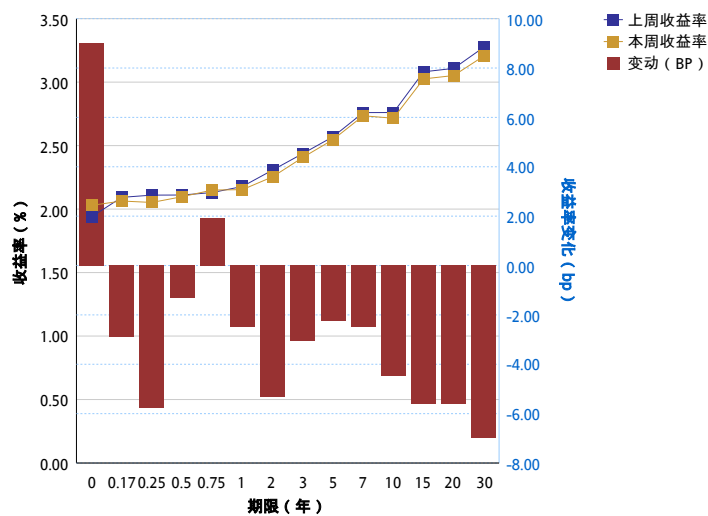
指数20160919--20160926

指数名称	指标名称	20160926	20160919	变化率(%)	上涨点数
中债-央票总指数	净价指数	102.2677	102.2946	-0.03	-0.0269
中债-央票总指数	平均市值法久期	0.0802	0.0992	-19.15	-0.0190
中债-央票总指数	财富指数	153.8673	153.8068	0.04	0.0605
中债-综合指数	净价指数	104.9264	104.8292	0.09	0.0972
中债-综合指数	平均市值法久期	4.0691	4.0536	0.38	0.0155
中债-综合指数	财富指数	179.8971	179.5876	0.17	0.3095

收益率曲线变动情况20160919-20160926

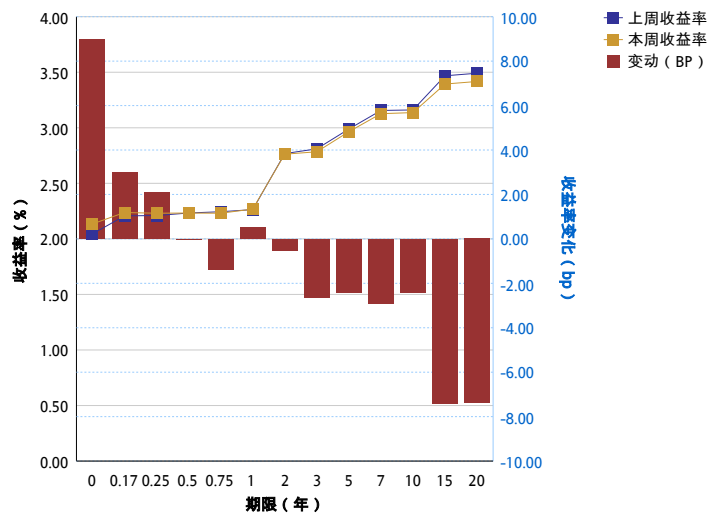
1.中债国债收益率曲线关键期限比较

期限 (年)	20160919	20160926	变动 (bp)
0.00	1.9392	2.0292	9.00
0.17	2.0925	2.0636	-2.89
0.25	2.1101	2.0523	-5.79
0.50	2.1109	2.0976	-1.32
0.75	2.1304	2.1498	1.94
1.00	2.1784	2.1534	-2.50
2.00	2.3076	2.2545	-5.31
3.00	2.4376	2.4070	-3.06
5.00	2.5699	2.5474	-2.26
7.00	2.7600	2.7350	-2.50
10.00	2.7605	2.7157	-4.49
15.00	3.0814	3.0253	-5.61
20.00	3.1083	3.0522	-5.61
30.00	3.2763	3.2065	-6.98
平均	2.4902	2.4635	-2.67



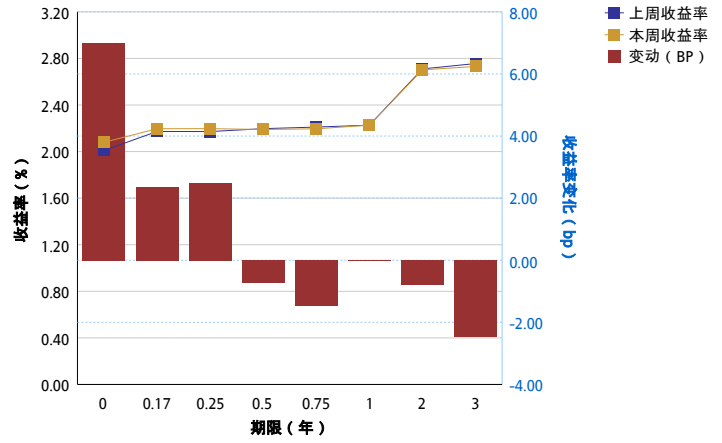
2.政策性银行债收益率曲线关键期限点比较

期限 (年)	20160919	20160926	变动 (bp)
0.00	2.0447	2.1347	9.00
0.17	2.2072	2.2373	3.01
0.25	2.2100	2.2311	2.11
0.50	2.2329	2.2328	-0.01
0.75	2.2444	2.2308	-1.36
1.00	2.2634	2.2684	0.50
2.00	2.7679	2.7626	-0.53
3.00	2.8103	2.7841	-2.62
5.00	2.9890	2.9648	-2.42
7.00	3.1561	3.1270	-2.91
10.00	3.1608	3.1368	-2.40
15.00	3.4680	3.3939	-7.41
20.00	3.4910	3.4171	-7.39
平均	2.6958	2.6863	-0.96



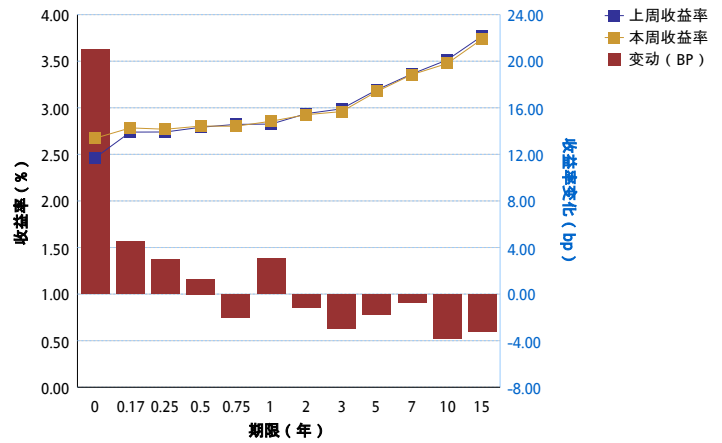
3.央票收益率曲线关键期限点比较

期限 (年)	20160919	20160926	变动 (bp)
0.00	2.0096	2.0796	7.00
0.17	2.1726	2.1961	2.35
0.25	2.1718	2.1967	2.49
0.50	2.1967	2.1896	-0.71
0.75	2.2104	2.1957	-1.48
1.00	2.2266	2.2266	0.00
2.00	2.7099	2.7020	-0.79
3.00	2.7557	2.7310	-2.47
平均	2.3067	2.3146	0.80



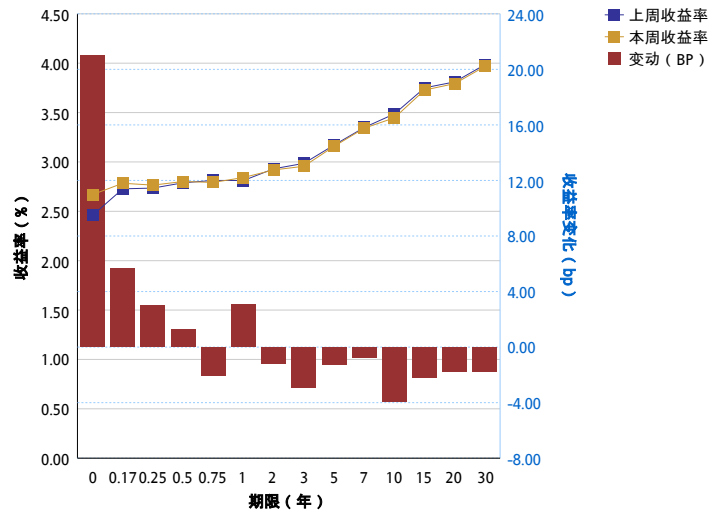
4.AAA中期票据收益率曲线关键期限点比较

期限 (年)	20160919	20160926	变动 (bp)
0.00	2.4629	2.6729	21.00
0.17	2.7387	2.7841	4.53
0.25	2.7401	2.7697	2.96
0.50	2.7908	2.8037	1.29
0.75	2.8219	2.8017	-2.02
1.00	2.8251	2.8556	3.05
2.00	2.9374	2.9257	-1.16
3.00	2.9885	2.9590	-2.94
5.00	3.1926	3.1750	-1.76
7.00	3.3636	3.3563	-0.73
10.00	3.5139	3.4755	-3.84
15.00	3.7730	3.7407	-3.23
平均	3.0124	3.0267	1.43



5.AAA企业债收益率曲线关键期限点比较

期限 (年)	20160919	20160926	变动 (bp)
0.00	2.4591	2.6691	21.00
0.17	2.7276	2.7843	5.66
0.25	2.7351	2.7652	3.01
0.50	2.7888	2.8017	1.29
0.75	2.8128	2.7926	-2.02
1.00	2.8119	2.8424	3.05
2.00	2.9306	2.9189	-1.17
3.00	2.9855	2.9561	-2.94
5.00	3.1707	3.1581	-1.26
7.00	3.3490	3.3417	-0.73
10.00	3.4866	3.4471	-3.95
15.00	3.7504	3.7282	-2.23
20.00	3.8110	3.7932	-1.78
30.00	3.9857	3.9680	-1.78
平均	3.1289	3.1405	1.16



市场交易概览20160919--20160926

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	10,591.44	155.92	10,824	228.10
2	质押式回购	49,686.68	49.53	11,689	57.58
3	买断式回购	2,718.93	195.54	2,099	132.71
4	远期交割	-	-	-	-
5	债券借贷	174.63	-31.32	101	134.88
汇总		63,171.68	92.42	24,713	138.32

现券交易情况20160919--20160926

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	7.50	-	16	-
中期票据	166.76	564.99	218	406.98
二级资本工具	52.98	1,792.14	65	1,525.00
保险公司金融债	6.20	-	4	-
商业银行债券	121.16	133.99	77	156.67
国际机构债券	6.10	-	7	-
地方企业债	642.19	217.25	1,211	201.24
地方政府债	452.20	118.03	207	239.34
扶贫专项金融债	48.80	10.91	19	137.50
政府支持机构债	33.99	69.11	73	135.48
政策性银行债券	7,144.01	135.03	6,917	208.93
记账式国债	1,877.27	246.42	1,972	323.18
资产支持证券	2.80	351.61	4	-66.67
集合企业债	3.68	-	7	-
非银行金融机构债	13.60	580.00	8	700.00
项目收益债券	12.20	1,425.00	19	850.00
合计	10,591.44	470.37	10,824	401.47

质押式回购交易情况20160919--20160926

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	29,165.79	6,214	0.0180	0.0300	0.0222
R01M	181.94	103	0.0270	0.0390	0.0333
R01Y	2.40	1	0.0300	0.0300	0.0300
R02D	99.51	62	0.0215	0.0300	0.0250
R02M	95.66	45	0.0280	0.0390	0.0352
R03D	13,774.19	2,824	0.0160	0.0300	0.0218
R03M	50.80	14	0.0278	0.0330	0.0299
R04M	1.00	1	0.0305	0.0305	0.0305
R06M	1.70	2	0.0310	0.0340	0.0330
R07D	1,724.78	727	0.0220	0.0360	0.0263
R09M	0.50	1	0.0375	0.0375	0.0375
R14D	2,560.43	751	0.0225	0.0400	0.0290
R21D	2,027.98	944	0.0246	0.0400	0.0325
合计	49,686.68	11,689	0.0160	0.0400	0.0297