

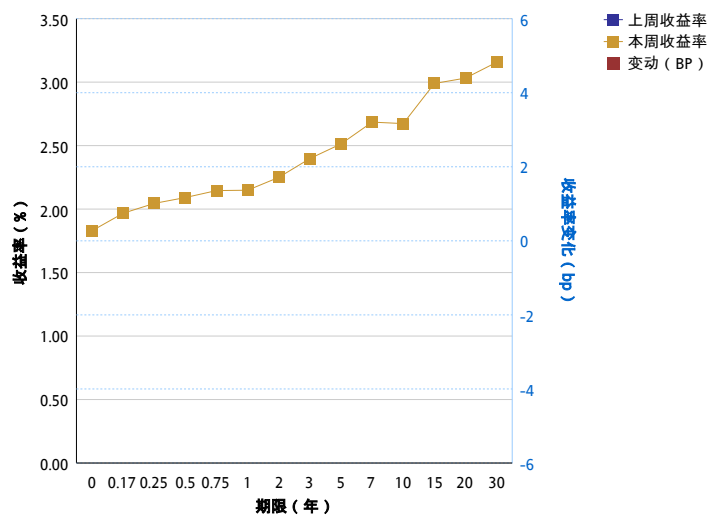
指数20161003--20161010

指数名称	指标名称	20161010	20161003	变化率(%)	上涨点数
中债-央票总指数	净价指数	102.2232			
中债-央票总指数	平均市值法久期	0.0598			
中债-央票总指数	财富指数	154.0018			
中债-综合指数	净价指数	105.0535			
中债-综合指数	平均市值法久期	4.0710			
中债-综合指数	财富指数	180.3811			

收益率曲线变动情况20161003-20161010

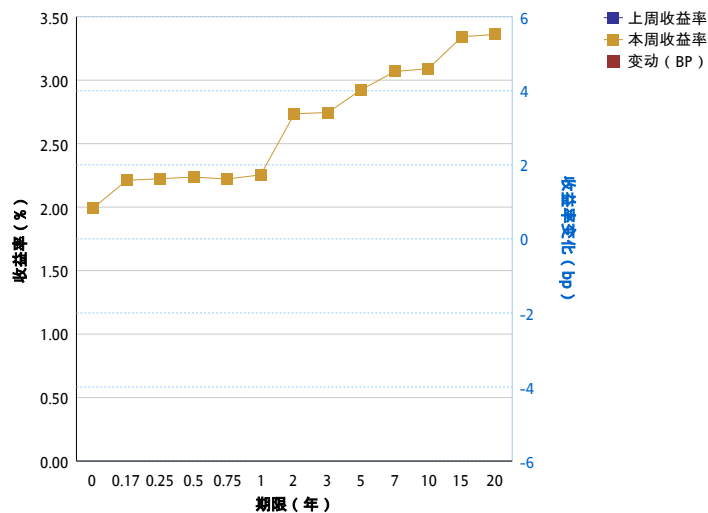
1.中债国债收益率曲线关键期限比较

期限 (年)	20161003	20161010	变动 (bp)
0.00	-	1.8292	-
0.17	-	1.9672	-
0.25	-	2.0448	-
0.50	-	2.0910	-
0.75	-	2.1460	-
1.00	-	2.1487	-
2.00	-	2.2499	-
3.00	-	2.3980	-
5.00	-	2.5134	-
7.00	-	2.6850	-
10.00	-	2.6735	-
15.00	-	2.9894	-
20.00	-	3.0319	-
30.00	-	3.1565	-
平均	-	2.4232	-



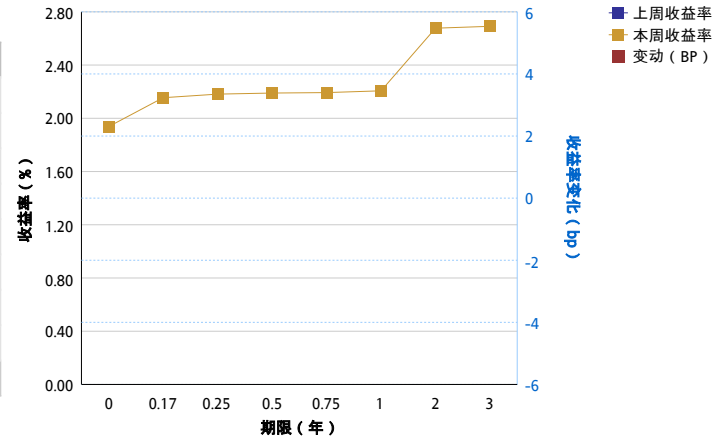
2.政策性银行债收益率曲线关键期限点比较

期限 (年)	20161003	20161010	变动 (bp)
0.00	-	1.9927	-
0.17	-	2.2117	-
0.25	-	2.2239	-
0.50	-	2.2368	-
0.75	-	2.2215	-
1.00	-	2.2546	-
2.00	-	2.7357	-
3.00	-	2.7451	-
5.00	-	2.9255	-
7.00	-	3.0684	-
10.00	-	3.0904	-
15.00	-	3.3425	-
20.00	-	3.3603	-
平均	-	2.6468	-



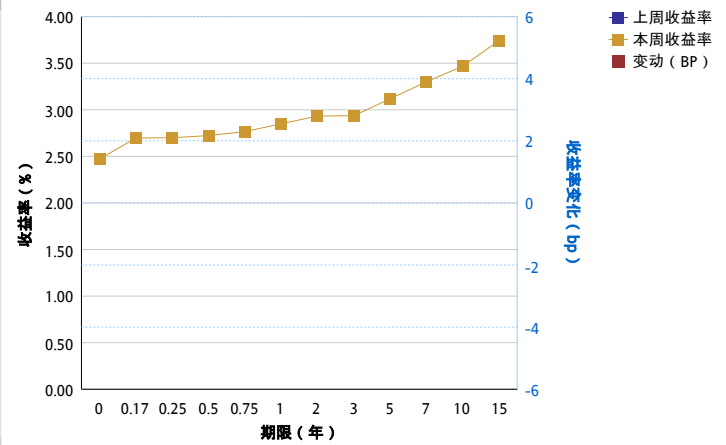
3.央票收益率曲线关键期限点比较

期限 (年)	20161003	20161010	变动 (bp)
0.00	-	1.9376	-
0.17	-	2.1546	-
0.25	-	2.1816	-
0.50	-	2.1897	-
0.75	-	2.1932	-
1.00	-	2.2066	-
2.00	-	2.6771	-
3.00	-	2.6912	-
平均	-	2.2789	-



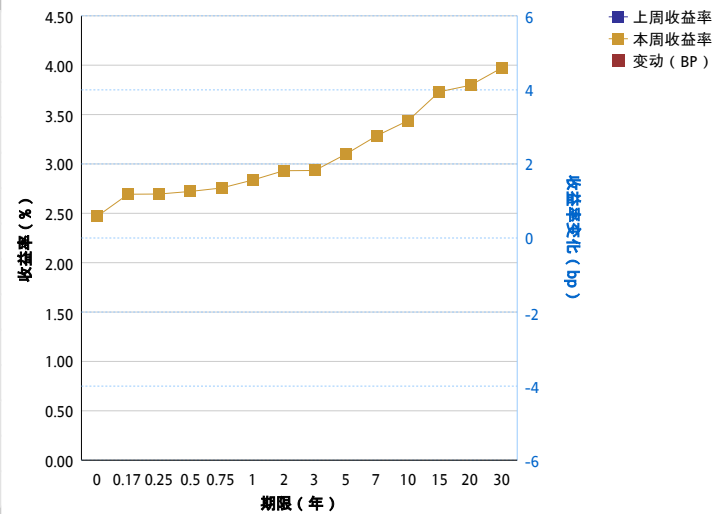
4.AAA中短期票据收益率曲线关键期限点比较

期限 (年)	20161003	20161010	变动 (bp)
0.00	-	2.4719	-
0.17	-	2.6969	-
0.25	-	2.6998	-
0.50	-	2.7231	-
0.75	-	2.7656	-
1.00	-	2.8498	-
2.00	-	2.9323	-
3.00	-	2.9368	-
5.00	-	3.1170	-
7.00	-	3.3019	-
10.00	-	3.4669	-
15.00	-	3.7435	-
平均	-	2.9755	-



5.AAA企业债收益率曲线关键期限点比较

期限 (年)	20161003	20161010	变动 (bp)
0.00	-	2.4681	-
0.17	-	2.6932	-
0.25	-	2.6953	-
0.50	-	2.7216	-
0.75	-	2.7565	-
1.00	-	2.8366	-
2.00	-	2.9315	-
3.00	-	2.9339	-
5.00	-	3.1002	-
7.00	-	3.2873	-
10.00	-	3.4398	-
15.00	-	3.7310	-
20.00	-	3.7970	-
30.00	-	3.9718	-
平均	-	3.0974	-



市场交易概览20161003--20161010

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	5,494.16	22.62	4,440	6.65
2	质押式回购	44,926.44	58.81	7,897	33.46
3	买断式回购	770.23	3.66	635	25.00
4	远期交割	-	-	-	-
5	债券借贷	71.30	21.69	29	38.10
汇总		51,262.13	26.70	13,001	25.80

现券交易情况20161003--20161010

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	6.00	-68.09	7	-75.00
中期票据	58.85	-8.95	91	-30.00
二级资本工具	13.50	0.15	19	-5.00
保险公司金融债	2.00	-91.30	1	-90.00
商业银行债券	34.31	-49.77	37	-28.85
国际机构债券	1.00	0.00	1	0.00
地方企业债	177.82	-40.28	328	-39.59
地方政府债	277.60	80.73	91	28.17
扶贫专项金融债	46.50	152.72	15	-11.76
政府支持机构债	7.00	-79.47	10	-66.67
政策性银行债券	4,021.07	46.06	3,206	30.91
记账式国债	846.60	-15.08	631	-18.05
资产支持证券	1.50	-93.15	2	-91.30
项目收益债券	0.40	-96.25	1	-93.33
合计	5,494.16	-18.76	4,440	-35.03

质押式回购交易情况20161003--20161010

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	41,580.11	6,686	0.0150	0.0260	0.0212
R01M	36.07	21	0.0270	0.0330	0.0283
R02D	118.07	62	0.0210	0.0272	0.0229
R02M	1.00	1	0.0290	0.0290	0.0290
R03D	40.34	23	0.0218	0.0270	0.0240
R03M	38.63	15	0.0278	0.0310	0.0285
R06M	1.00	1	0.0290	0.0290	0.0290
R07D	1,273.63	646	0.0225	0.0275	0.0246
R14D	1,703.74	407	0.0210	0.0330	0.0241
R21D	133.85	35	0.0239	0.0285	0.0255
合计	44,926.44	7,897	0.0150	0.0330	0.0257