

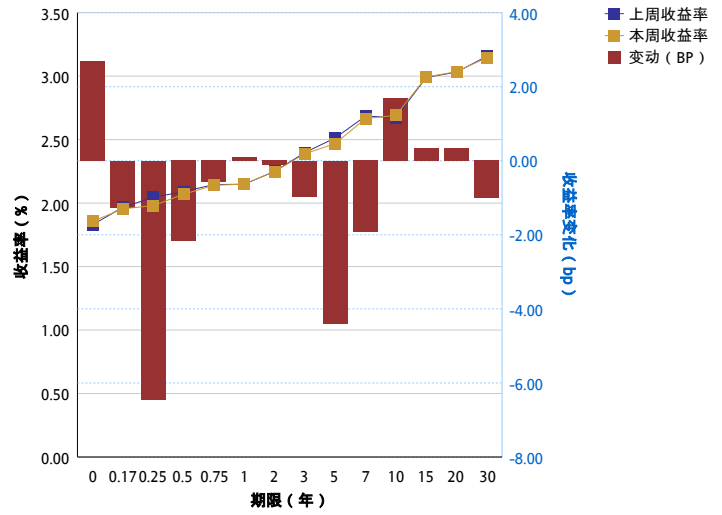
## 指数20161010--20161017

指数名称	指标名称	20161017	20161010	变化率(%)	上涨点数
中债-央票总指数	净价指数	102.2006	102.2232	-0.02	-0.0226
中债-央票总指数	平均市值法久期	0.0568	0.0598	-5.02	-0.0030
中债-央票总指数	财富指数	154.0686	154.0018	0.04	0.0668
中债-综合指数	净价指数	105.0913	105.0535	0.04	0.0378
中债-综合指数	平均市值法久期	4.0882	4.0710	0.42	0.0172
中债-综合指数	财富指数	180.6047	180.3811	0.12	0.2236

# 收益率曲线变动情况20161010-20161017

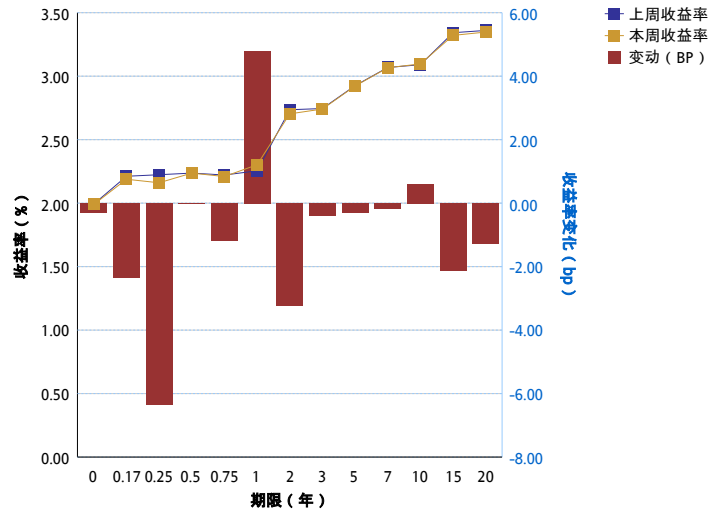
## 1.中债国债收益率曲线关键期限比较

期限 (年)	20161010	20161017	变动 (bp)
0.00	1.8292	1.8562	2.70
0.17	1.9672	1.9546	-1.27
0.25	2.0448	1.9803	-6.45
0.50	2.0910	2.0693	-2.17
0.75	2.1460	2.1402	-0.58
1.00	2.1487	2.1495	0.08
2.00	2.2499	2.2487	-0.12
3.00	2.3980	2.3884	-0.97
5.00	2.5134	2.4694	-4.40
7.00	2.6850	2.6658	-1.92
10.00	2.6735	2.6904	1.68
15.00	2.9894	2.9929	0.35
20.00	3.0319	3.0354	0.35
30.00	3.1565	3.1464	-1.01
平均	2.4232	2.4134	-0.98



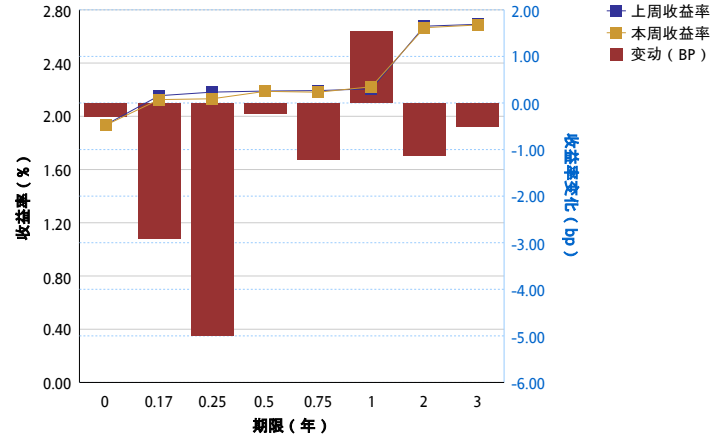
## 2.政策性银行债收益率曲线关键期限点比较

期限 (年)	20161010	20161017	变动 (bp)
0.00	1.9927	1.9897	-0.30
0.17	2.2117	2.1883	-2.34
0.25	2.2239	2.1605	-6.34
0.50	2.2368	2.2365	-0.03
0.75	2.2215	2.2096	-1.19
1.00	2.2546	2.3025	4.79
2.00	2.7357	2.7033	-3.24
3.00	2.7451	2.7413	-0.38
5.00	2.9255	2.9225	-0.30
7.00	3.0684	3.0666	-0.17
10.00	3.0904	3.0965	0.60
15.00	3.3425	3.3213	-2.11
20.00	3.3603	3.3475	-1.28
平均	2.6468	2.6374	-0.94



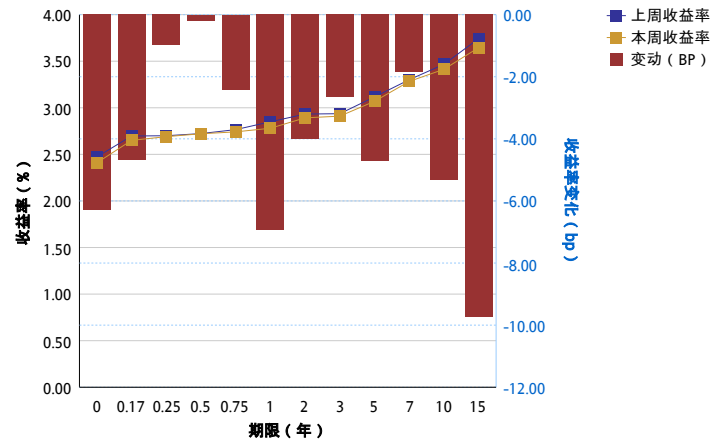
## 3.央票收益率曲线关键期限点比较

期限 (年)	20161010	20161017	变动 (bp)
0.00	1.9376	1.9346	-0.30
0.17	2.1546	2.1256	-2.91
0.25	2.1816	2.1316	-4.99
0.50	2.1897	2.1874	-0.23
0.75	2.1932	2.1811	-1.21
1.00	2.2066	2.2220	1.54
2.00	2.6771	2.6658	-1.13
3.00	2.6912	2.6861	-0.51
平均	<b>2.2789</b>	<b>2.2668</b>	<b>-1.22</b>



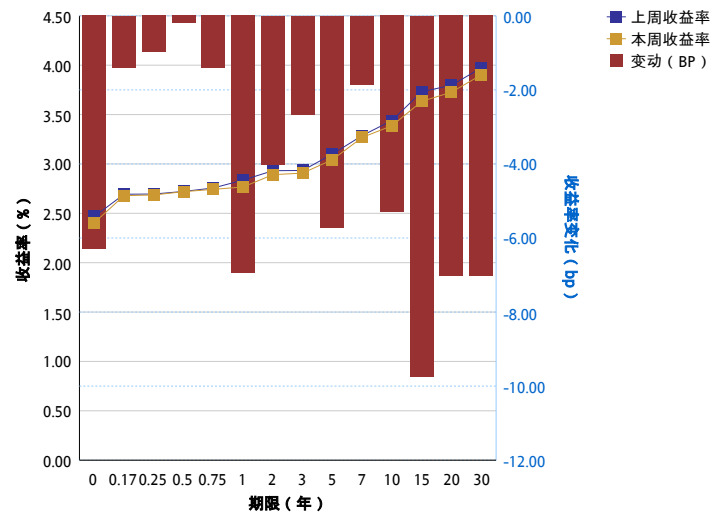
4.AAA中短期票据收益率曲线关键期限点比较

期限 (年)	20161010	20161017	变动 (bp)
0.00	2.4719	2.4089	-6.30
0.17	2.6969	2.6500	-4.69
0.25	2.6998	2.6901	-0.97
0.50	2.7231	2.7212	-0.19
0.75	2.7656	2.7415	-2.41
1.00	2.8498	2.7804	-6.94
2.00	2.9323	2.8922	-4.01
3.00	2.9368	2.9101	-2.66
5.00	3.1170	3.0699	-4.70
7.00	3.3019	3.2833	-1.86
10.00	3.4669	3.4138	-5.31
15.00	3.7435	3.6461	-9.74
平均	<b>2.9755</b>	<b>2.9340</b>	<b>-4.15</b>



5.AAA企业债收益率曲线关键期限点比较

期限 (年)	20161010	20161017	变动 (bp)
0.00	2.4681	2.4051	-6.30
0.17	2.6932	2.6793	-1.40
0.25	2.6953	2.6856	-0.97
0.50	2.7216	2.7197	-0.19
0.75	2.7565	2.7424	-1.41
1.00	2.8366	2.7671	-6.94
2.00	2.9315	2.8914	-4.01
3.00	2.9339	2.9072	-2.67
5.00	3.1002	3.0431	-5.71
7.00	3.2873	3.2687	-1.86
10.00	3.4398	3.3868	-5.30
15.00	3.7310	3.6336	-9.74
20.00	3.7970	3.7267	-7.03
30.00	3.9718	3.9015	-7.03
平均	<b>3.0974</b>	<b>3.0541</b>	<b>-4.33</b>



## 市场交易概览20161010--20161017

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	11,814.13	115.03	13,682	208.15
2	质押式回购	65,329.87	45.42	14,095	78.49
3	买断式回购	2,662.49	245.68	2,449	285.67
4	远期交割	-	-	-	-
5	债券借贷	143.10	100.70	78	168.97
<b>汇总</b>		<b>79,949.59</b>	<b>126.71</b>	<b>30,304</b>	<b>185.32</b>

## 现券交易情况20161010--20161017

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	8.30	38.33	20	185.71
中期票据	127.56	116.75	209	129.67
二级资本工具	7.84	-41.93	17	-10.53
商业银行债券	45.60	32.89	55	48.65
国际机构债券	6.00	500.00	6	500.00
地方企业债	666.77	274.97	1,258	283.54
地方政府债	432.35	55.75	190	108.79
扶贫专项金融债	15.30	-67.10	12	-20.00
政府支持机构债	47.10	572.86	79	690.00
政策性银行债券	8,839.56	119.83	9,729	203.46
记账式国债	1,587.77	87.55	2,064	227.10
非银行金融机构债	10.88	-	10	-
项目收益债券	19.10	4,675.00	33	3,200.00
<b>合计</b>	<b>11,814.13</b>	<b>530.41</b>	<b>13,682</b>	<b>462.20</b>

## 质押式回购交易情况20161010--20161017

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	39,565.12	7,582	0.0190	0.0350	0.0219
R01M	115.76	61	0.0245	0.0340	0.0282
R02D	76.59	45	0.0220	0.0280	0.0247
R02M	26.60	25	0.0270	0.0340	0.0286
R03D	19,164.09	3,721	0.0190	0.0280	0.0217
R03M	61.99	25	0.0278	0.0340	0.0296
R04M	1.00	1	0.0295	0.0295	0.0295
R06M	0.50	1	0.0310	0.0310	0.0310
R07D	5,443.71	2,273	0.0200	0.0350	0.0247
R14D	797.44	300	0.0235	0.0320	0.0258
R21D	77.05	61	0.0250	0.0300	0.0275
<b>合计</b>	<b>65,329.87</b>	<b>14,095</b>	<b>0.0190</b>	<b>0.0350</b>	<b>0.0266</b>