

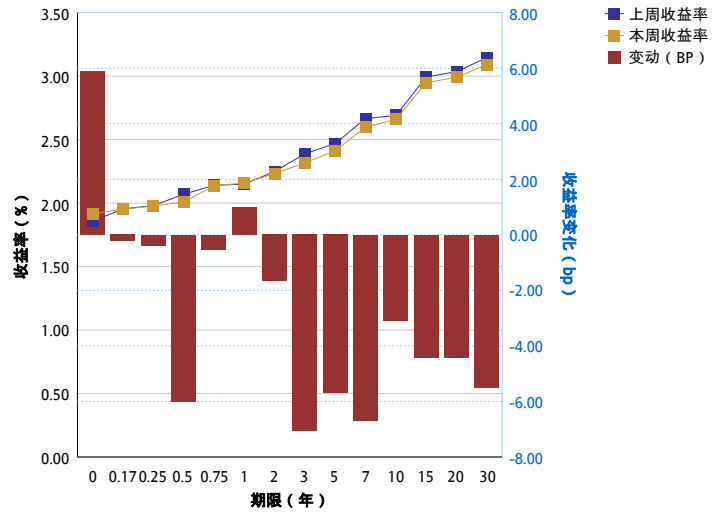
指数20161017--20161024

指数名称	指标名称	20161024	20161017	变化率(%)	上涨点数
中债-央票总指数	净价指数	102.1745	102.2006	-0.03	-0.0261
中债-央票总指数	平均市值法久期	0.0377	0.0568	-33.63	-0.0191
中债-央票总指数	财富指数	154.1303	154.0686	0.04	0.0617
中债-综合指数	净价指数	105.2314	105.0913	0.13	0.1401
中债-综合指数	平均市值法久期	4.1098	4.0882	0.53	0.0216
中债-综合指数	财富指数	181.0069	180.6047	0.22	0.4022

收益率曲线变动情况20161017-20161024

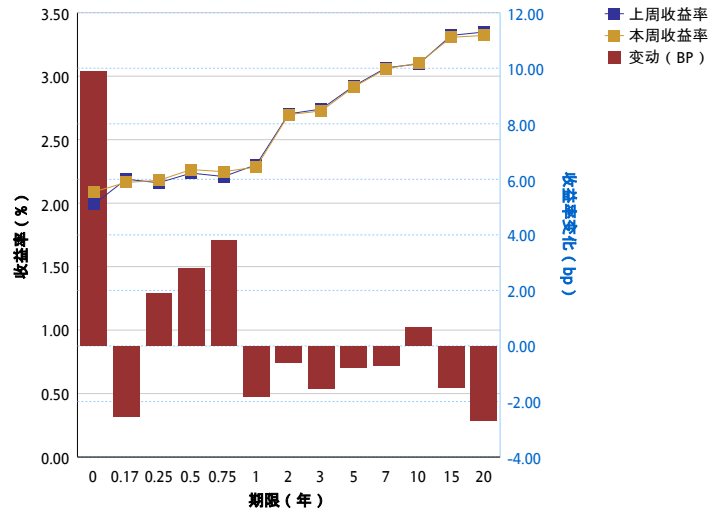
1.中债国债收益率曲线关键期限比较

期限 (年)	20161017	20161024	变动 (bp)
0.00	1.8562	1.9152	5.90
0.17	1.9546	1.9524	-0.22
0.25	1.9803	1.9765	-0.38
0.50	2.0693	2.0094	-5.99
0.75	2.1402	2.1349	-0.53
1.00	2.1495	2.1593	0.98
2.00	2.2487	2.2320	-1.67
3.00	2.3884	2.3177	-7.07
5.00	2.4694	2.4124	-5.70
7.00	2.6658	2.5989	-6.69
10.00	2.6904	2.6595	-3.09
15.00	2.9929	2.9487	-4.42
20.00	3.0354	2.9912	-4.42
30.00	3.1464	3.0914	-5.51
平均	2.4134	2.3857	-2.77



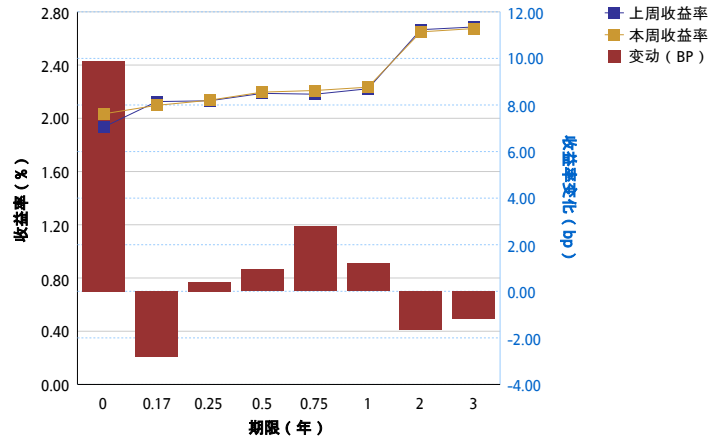
2.政策性银行债收益率曲线关键期限点比较

期限 (年)	20161017	20161024	变动 (bp)
0.00	1.9897	2.0887	9.90
0.17	2.1883	2.1629	-2.54
0.25	2.1605	2.1793	1.88
0.50	2.2365	2.2643	2.78
0.75	2.2096	2.2477	3.80
1.00	2.3025	2.2844	-1.81
2.00	2.7033	2.6974	-0.59
3.00	2.7413	2.7261	-1.52
5.00	2.9225	2.9146	-0.79
7.00	3.0666	3.0596	-0.70
10.00	3.0965	3.1031	0.66
15.00	3.3213	3.3064	-1.49
20.00	3.3475	3.3207	-2.68
平均	2.6374	2.6427	0.53



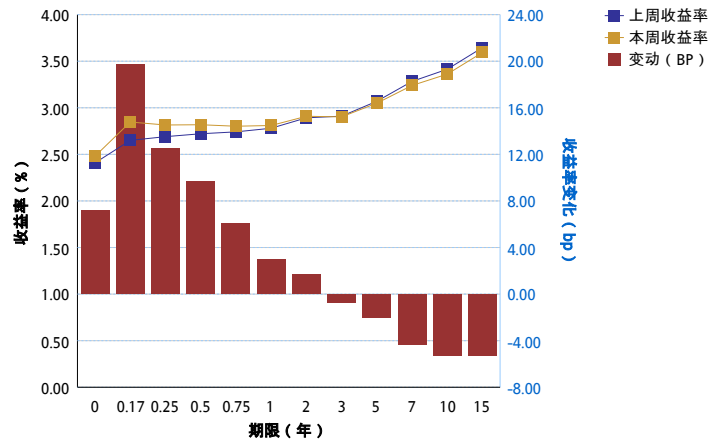
3.央票收益率曲线关键期限点比较

期限 (年)	20161017	20161024	变动 (bp)
0.00	1.9346	2.0336	9.90
0.17	2.1256	2.0974	-2.81
0.25	2.1316	2.1358	0.41
0.50	2.1874	2.1967	0.93
0.75	2.1811	2.2088	2.78
1.00	2.2220	2.2339	1.19
2.00	2.6658	2.6494	-1.64
3.00	2.6861	2.6742	-1.19
平均	2.2668	2.2787	1.20



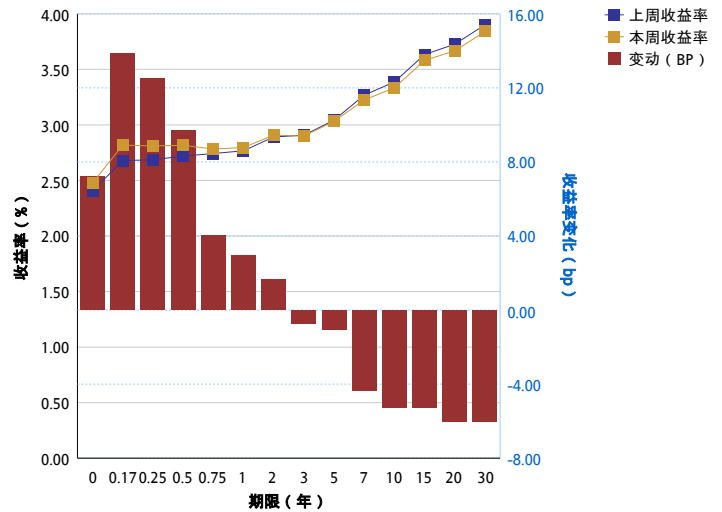
4.AAA中短期票据收益率曲线关键期限点比较

期限 (年)	20161017	20161024	变动 (bp)
0.00	2.4089	2.4809	7.20
0.17	2.6500	2.8472	19.72
0.25	2.6901	2.8151	12.50
0.50	2.7212	2.8181	9.69
0.75	2.7415	2.8019	6.04
1.00	2.7804	2.8099	2.95
2.00	2.8922	2.9087	1.66
3.00	2.9101	2.9026	-0.75
5.00	3.0699	3.0493	-2.06
7.00	3.2833	3.2397	-4.36
10.00	3.4138	3.3613	-5.25
15.00	3.6461	3.5936	-5.25
平均	2.9340	2.9690	3.51



5.AAA企业债收益率曲线关键期限点比较

期限 (年)	20161017	20161024	变动 (bp)
0.00	2.4051	2.4771	7.20
0.17	2.6793	2.8179	13.86
0.25	2.6856	2.8106	12.50
0.50	2.7197	2.8166	9.69
0.75	2.7424	2.7828	4.04
1.00	2.7671	2.7966	2.95
2.00	2.8914	2.9079	1.65
3.00	2.9072	2.8997	-0.75
5.00	3.0431	3.0324	-1.06
7.00	3.2687	3.2250	-4.36
10.00	3.3868	3.3343	-5.25
15.00	3.6336	3.5811	-5.25
20.00	3.7267	3.6663	-6.04
30.00	3.9015	3.8411	-6.04
平均	3.0541	3.0707	1.65



市场交易概览20161017--20161024

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	9,441.04	-20.09	12,133	-11.32
2	质押式回购	48,665.40	-25.51	13,834	-1.85
3	买断式回购	2,249.49	-15.51	2,317	-5.39
4	远期交割	-	-	-	-
5	债券借贷	239.92	67.66	116	48.72
汇总		60,595.85	1.64	28,400	7.54

现券交易情况20161017--20161024

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	81.34	880.00	34	70.00
中期票据	218.11	70.98	204	-2.39
二级资本工具	76.82	879.85	32	88.24
保险公司金融债	4.20	-	8	-
商业银行债券	99.19	117.53	71	29.09
国际机构债券	6.00	0.00	6	0.00
地方企业债	678.26	1.72	1,281	1.83
地方政府债	505.40	16.90	225	18.42
扶贫专项金融债	3.00	-80.39	5	-58.33
政府支持机构债	52.10	10.61	73	-7.59
政策性银行债券	6,140.87	-30.53	7,784	-19.99
记账式国债	1,536.19	-3.25	2,354	14.05
资产支持证券	1.60	-	5	-
非银行金融机构债	15.60	43.40	11	10.00
项目收益债券	22.37	17.12	40	21.21
合计	9,441.04	148.00	12,133	12.66

质押式回购交易情况20161017--20161024

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	27,332.89	6,820	0.0190	0.0360	0.0240
R01M	399.59	132	0.0272	0.0450	0.0303
R02D	36.91	45	0.0242	0.0350	0.0310
R02M	73.21	30	0.0270	0.0320	0.0298
R03D	13,413.64	3,498	0.0200	0.0370	0.0249
R03M	20.85	12	0.0280	0.0340	0.0310
R06M	6.20	6	0.0310	0.0320	0.0313
R07D	4,210.57	1,978	0.0225	0.0380	0.0300
R14D	2,832.34	1,087	0.0230	0.0370	0.0322
R21D	339.20	226	0.0290	0.0360	0.0324
合计	48,665.40	13,834	0.0190	0.0450	0.0297