

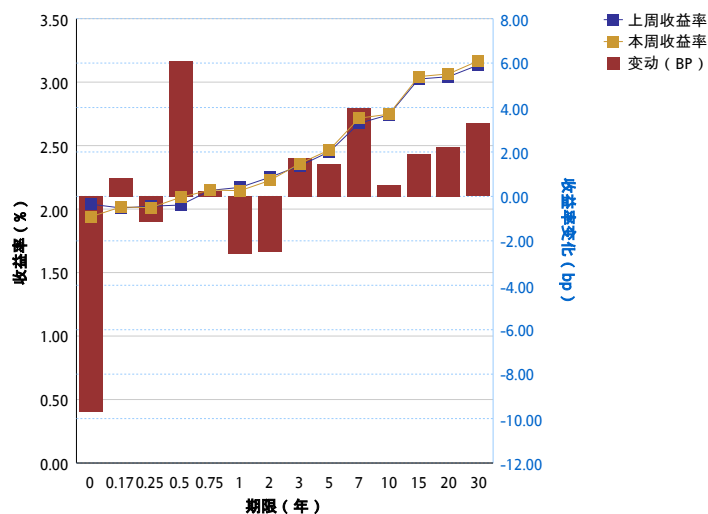
## 指数20161031--20161107

指数名称	指标名称	20161107	20161031	变化率(%)	上涨点数
中债-央票总指数	净价指数	102.1237	102.1426	-0.02	-0.0189
中债-央票总指数	平均市值法久期	0.0137	0.0328	-58.23	-0.0191
中债-央票总指数	财富指数	154.2556	154.1835	0.05	0.0721
中债-综合指数	净价指数	104.9096	104.9961	-0.08	-0.0865
中债-综合指数	平均市值法久期	4.1079	4.0993	0.21	0.0086
中债-综合指数	财富指数	180.7505	180.7569	0.00	-0.0064

# 收益率曲线变动情况20161031-20161107

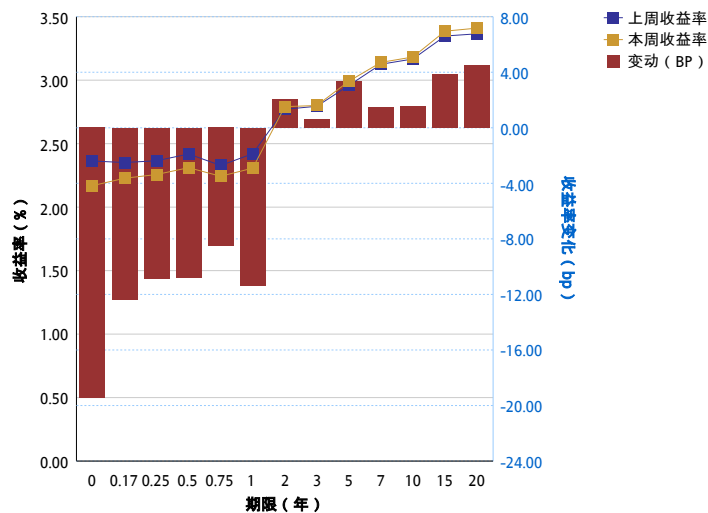
## 1.中债国债收益率曲线关键期限比较

期限 (年)	20161031	20161107	变动 (bp)
0.00	2.0381	1.9411	-9.70
0.17	2.0089	2.0171	0.82
0.25	2.0229	2.0113	-1.16
0.50	2.0319	2.0927	6.08
0.75	2.1475	2.1500	0.24
1.00	2.1711	2.1451	-2.61
2.00	2.2507	2.2258	-2.50
3.00	2.3407	2.3581	1.74
5.00	2.4518	2.4663	1.45
7.00	2.6762	2.7161	3.99
10.00	2.7425	2.7475	0.50
15.00	3.0245	3.0437	1.92
20.00	3.0426	3.0649	2.23
30.00	3.1343	3.1671	3.29
平均	<b>2.4346</b>	<b>2.4391</b>	<b>0.45</b>



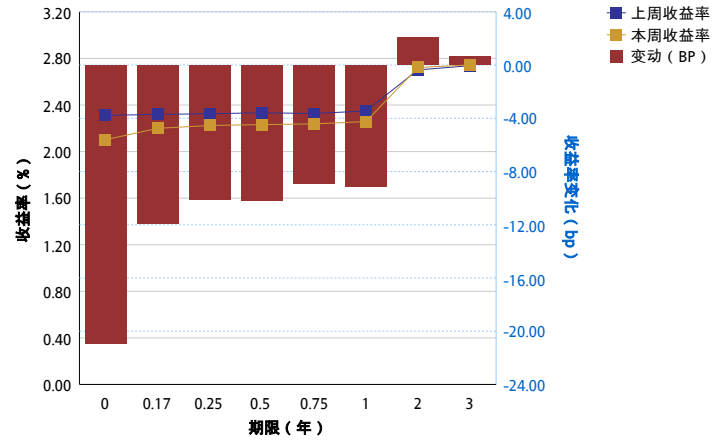
## 2.政策性银行债收益率曲线关键期限点比较

期限 (年)	20161031	20161107	变动 (bp)
0.00	2.3635	2.1690	-19.45
0.17	2.3514	2.2276	-12.39
0.25	2.3654	2.2569	-10.85
0.50	2.4185	2.3108	-10.77
0.75	2.3285	2.2433	-8.52
1.00	2.4206	2.3071	-11.35
2.00	2.7708	2.7914	2.06
3.00	2.7945	2.8006	0.61
5.00	2.9585	2.9919	3.34
7.00	3.1254	3.1402	1.48
10.00	3.1671	3.1826	1.55
15.00	3.3479	3.3861	3.83
20.00	3.3653	3.4101	4.48
平均	<b>2.7521</b>	<b>2.7091</b>	<b>-4.30</b>



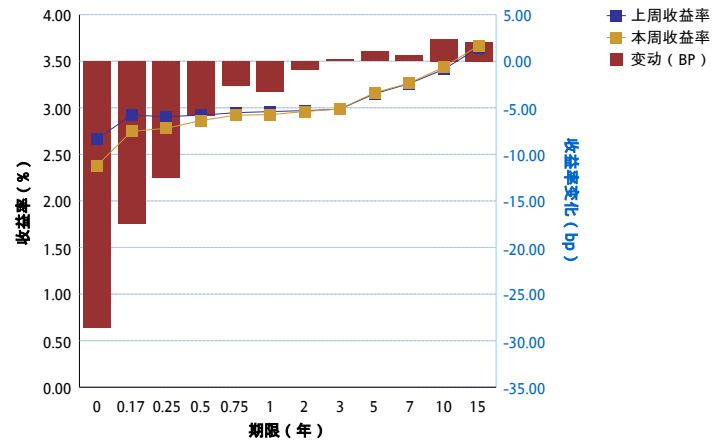
## 3.央票收益率曲线关键期限点比较

期限 (年)	20161031	20161107	变动 (bp)
0.00	2.3111	2.1019	-20.92
0.17	2.3187	2.1994	-11.93
0.25	2.3250	2.2241	-10.09
0.50	2.3331	2.2316	-10.15
0.75	2.3267	2.2374	-8.93
1.00	2.3484	2.2574	-9.10
2.00	2.7016	2.7222	2.06
3.00	2.7373	2.7439	0.66
平均	<b>2.4252</b>	<b>2.3397</b>	<b>-8.55</b>



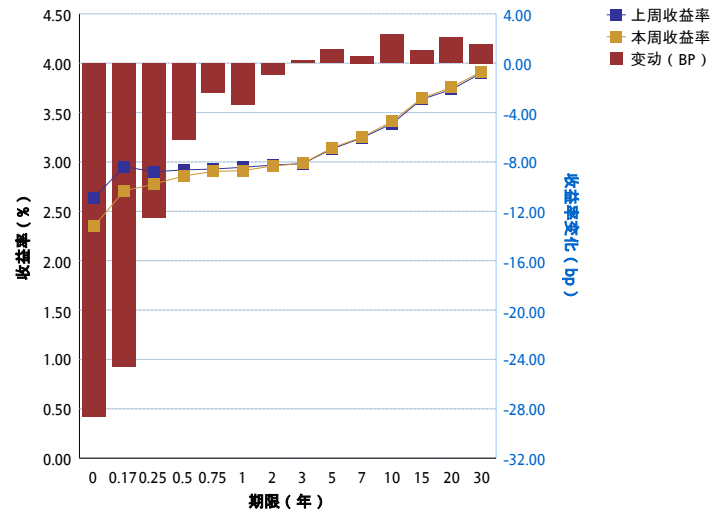
4.AAA中短期票据收益率曲线关键期限点比较

期限 (年)	20161031	20161107	变动 (bp)
0.00	2.6630	2.3767	-28.63
0.17	2.9217	2.7469	-17.48
0.25	2.9048	2.7795	-12.53
0.50	2.9210	2.8628	-5.82
0.75	2.9469	2.9207	-2.62
1.00	2.9594	2.9261	-3.32
2.00	2.9694	2.9601	-0.93
3.00	2.9854	2.9874	0.20
5.00	3.1502	3.1609	1.07
7.00	3.2596	3.2655	0.59
10.00	3.4138	3.4377	2.39
15.00	3.6461	3.6668	2.07
平均	<b>3.0618</b>	<b>3.0076</b>	<b>-5.42</b>



5.AAA企业债收益率曲线关键期限点比较

期限 (年)	20161031	20161107	变动 (bp)
0.00	2.6392	2.3529	-28.63
0.17	2.9531	2.7071	-24.59
0.25	2.9003	2.7750	-12.53
0.50	2.9195	2.8579	-6.16
0.75	2.9278	2.9037	-2.41
1.00	2.9460	2.9128	-3.32
2.00	2.9687	2.9595	-0.92
3.00	2.9825	2.9845	0.20
5.00	3.1333	3.1443	1.10
7.00	3.2450	3.2509	0.59
10.00	3.3868	3.4101	2.33
15.00	3.6336	3.6443	1.07
20.00	3.7338	3.7546	2.08
30.00	3.8986	3.9142	1.56
平均	<b>3.1620</b>	<b>3.1123</b>	<b>-4.97</b>



## 市场交易概览20161031--20161107

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	9,170.59	7.39	9,636	-17.48
2	质押式回购	54,480.45	20.72	12,129	-1.98
3	买断式回购	2,492.93	20.09	2,220	8.61
4	远期交割	-	-	-	-
5	债券借贷	149.97	-44.82	63	-52.63
<b>汇总</b>		<b>66,293.94</b>	<b>0.84</b>	<b>24,048</b>	<b>-15.87</b>

## 现券交易情况20161031--20161107

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	7.90	-51.53	13	-61.76
中期票据	171.52	112.03	303	100.66
二级资本工具	15.83	-67.90	24	-40.00
商业银行债券	36.61	-27.97	44	-10.20
国际机构债券	1.00	-83.33	1	-83.33
地方企业债	766.45	3.44	1,526	2.14
地方政府债	587.20	36.11	255	25.00
扶贫专项金融债	18.30	18,200.00	5	400.00
政府支持机构债	31.20	-57.49	30	-63.41
政策性银行债券	6,092.27	9.51	5,831	-21.56
记账式国债	1,389.20	-7.04	1,543	-27.83
资产支持证券	16.60	1,560.00	9	350.00
非银行金融机构债	10.04	-31.11	10	-28.57
项目收益债券	26.47	174.59	42	200.00
<b>合计</b>	<b>9,170.59</b>	<b>1,412.09</b>	<b>9,636</b>	<b>52.94</b>

## 质押式回购交易情况20161031--20161107

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	33,644.35	6,660	0.0180	0.0350	0.0218
R01M	145.92	62	0.0275	0.0340	0.0289
R01Y	45.00	1	0.0300	0.0300	0.0300
R02D	26.05	23	0.0200	0.0275	0.0226
R02M	61.94	28	0.0276	0.0340	0.0296
R03D	16,103.66	3,344	0.0180	0.0300	0.0215
R03M	162.54	41	0.0285	0.0350	0.0314
R04M	16.00	9	0.0290	0.0330	0.0316
R06M	4.00	4	0.0305	0.0330	0.0318
R07D	3,780.85	1,733	0.0200	0.0300	0.0247
R14D	458.68	207	0.0234	0.0330	0.0259
R21D	31.46	17	0.0260	0.0290	0.0273
<b>合计</b>	<b>54,480.45</b>	<b>12,129</b>	<b>0.0180</b>	<b>0.0350</b>	<b>0.0273</b>