

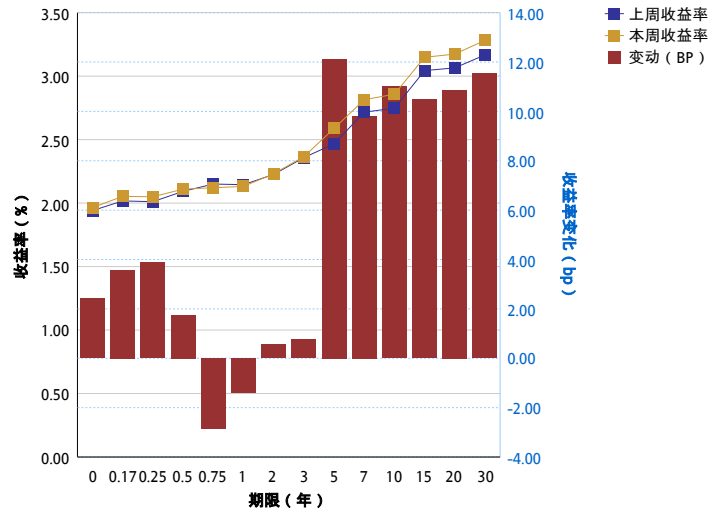
指数20161107--20161114

指数名称	指标名称	20161114	20161107	变化率(%)	上涨点数
中债-综合指数	净价指数	104.5308	104.9096	-0.36	-0.3788
中债-综合指数	平均市值法久期	4.0844	4.1079	-0.57	-0.0235
中债-综合指数	财富指数	180.2516	180.7505	-0.28	-0.4989

收益率曲线变动情况20161107-20161114

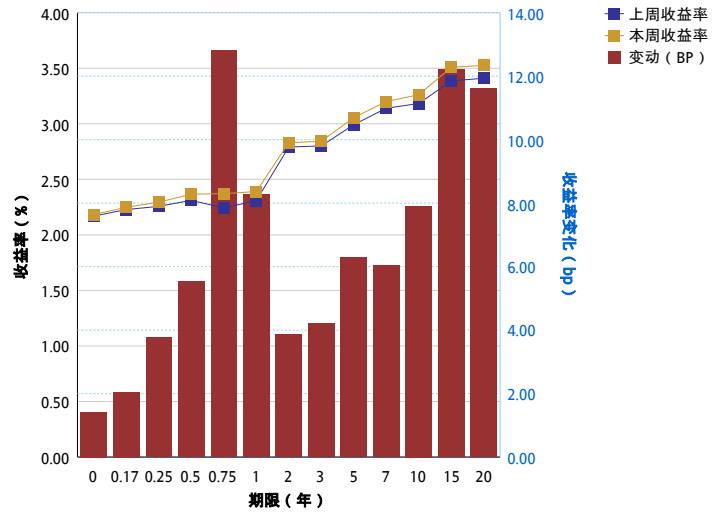
1.中债国债收益率曲线关键期限比较

期限 (年)	20161107	20161114	变动 (bp)
0.00	1.9411	1.9653	2.42
0.17	2.0171	2.0529	3.59
0.25	2.0113	2.0500	3.87
0.50	2.0927	2.1101	1.74
0.75	2.1500	2.1212	-2.87
1.00	2.1451	2.1313	-1.38
2.00	2.2258	2.2314	0.57
3.00	2.3581	2.3656	0.75
5.00	2.4663	2.5877	12.13
7.00	2.7161	2.8143	9.82
10.00	2.7475	2.8577	11.01
15.00	3.0437	3.1486	10.49
20.00	3.0649	3.1736	10.86
30.00	3.1671	3.2825	11.54
平均	2.4391	2.4923	5.32



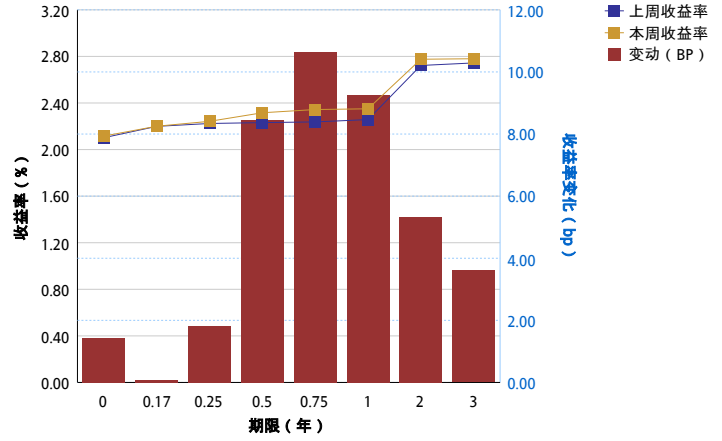
2.政策性银行债收益率曲线关键期限点比较

期限 (年)	20161107	20161114	变动 (bp)
0.00	2.1690	2.1832	1.42
0.17	2.2276	2.2481	2.05
0.25	2.2569	2.2945	3.76
0.50	2.3108	2.3661	5.53
0.75	2.2433	2.3712	12.80
1.00	2.3071	2.3897	8.26
2.00	2.7914	2.8300	3.86
3.00	2.8006	2.8426	4.20
5.00	2.9919	3.0549	6.30
7.00	3.1402	3.2006	6.04
10.00	3.1826	3.2617	7.91
15.00	3.3861	3.5084	12.22
20.00	3.4101	3.5263	11.62
平均	2.7091	2.7752	6.61



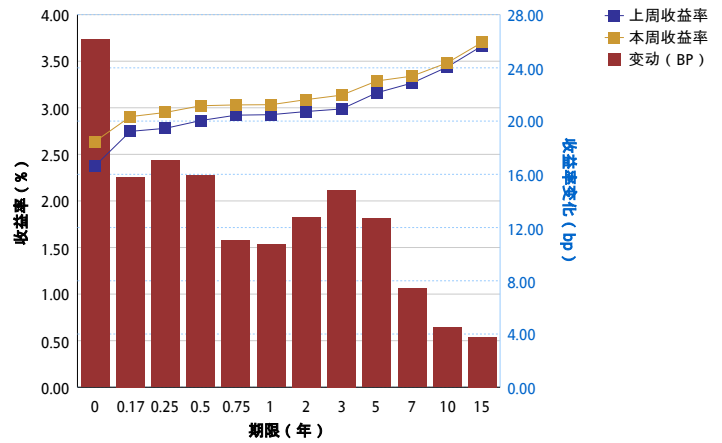
3.央票收益率曲线关键期限点比较

期限 (年)	20161107	20161114	变动 (bp)
0.00	2.1019	2.1161	1.42
0.17	2.1994	2.2003	0.09
0.25	2.2241	2.2424	1.83
0.50	2.2316	2.3160	8.44
0.75	2.2374	2.3437	10.63
1.00	2.2574	2.3500	9.26
2.00	2.7222	2.7756	5.34
3.00	2.7439	2.7800	3.61
平均	2.3397	2.3905	5.08



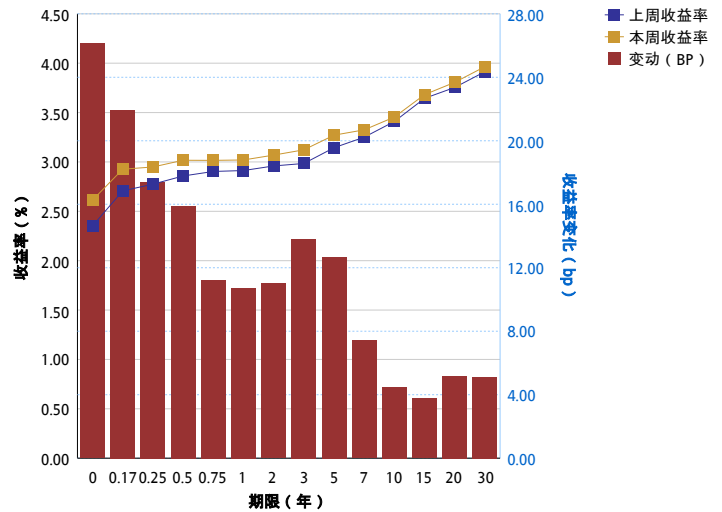
4.AAA中短期票据收益率曲线关键期限点比较

期限 (年)	20161107	20161114	变动 (bp)
0.00	2.3767	2.6379	26.12
0.17	2.7469	2.9049	15.79
0.25	2.7795	2.9500	17.05
0.50	2.8628	3.0218	15.89
0.75	2.9207	3.0308	11.01
1.00	2.9261	3.0333	10.72
2.00	2.9601	3.0880	12.79
3.00	2.9874	3.1356	14.81
5.00	3.1609	3.2876	12.67
7.00	3.2655	3.3398	7.43
10.00	3.4377	3.4825	4.48
15.00	3.6668	3.7045	3.77
平均	3.0076	3.1347	12.71



5.AAA企业债收益率曲线关键期限点比较

期限 (年)	20161107	20161114	变动 (bp)
0.00	2.3529	2.6141	26.12
0.17	2.7071	2.9264	21.93
0.25	2.7750	2.9490	17.40
0.50	2.8579	3.0169	15.90
0.75	2.9037	3.0160	11.23
1.00	2.9128	3.0200	10.72
2.00	2.9595	3.0694	10.99
3.00	2.9845	3.1226	13.81
5.00	3.1443	3.2710	12.67
7.00	3.2509	3.3252	7.43
10.00	3.4101	3.4549	4.48
15.00	3.6443	3.6820	3.77
20.00	3.7546	3.8064	5.18
30.00	3.9142	3.9654	5.12
平均	3.1123	3.2314	11.91



市场交易概览20161107--20161114

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	9,343.47	1.89	11,457	18.90
2	质押式回购	56,428.97	3.58	14,166	16.79
3	买断式回购	2,559.80	2.68	2,308	3.96
4	远期交割	-	-	-	-
5	债券借贷	252.10	68.10	136	115.87
汇总		68,584.35	19.06	28,067	38.88

现券交易情况20161107--20161114

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	4.50	-43.04	9	-30.77
中期票据	90.93	-46.98	128	-57.76
二级资本工具	43.45	174.48	29	20.83
商业银行债券	35.07	-4.20	41	-6.82
地方企业债	759.49	-0.91	1,325	-13.17
地方政府债	275.00	-53.17	137	-46.27
扶贫专项金融债	159.30	770.49	33	560.00
政府支持机构债	69.30	122.12	36	20.00
政策性银行债券	6,144.00	0.85	7,457	27.89
记账式国债	1,708.58	22.99	2,187	41.74
资产支持证券	1.74	-89.52	4	-55.56
集合企业债	1.20	-	2	-
非银行金融机构债	13.70	36.40	16	60.00
项目收益债券	37.20	40.54	53	26.19
合计	9,343.47	71.54	11,457	42.02

质押式回购交易情况20161107--20161114

交易期限品种	正回购金额 (亿元)	正回购笔数	利率 (最小)	利率 (最大)	利率 (平均)
R01D	32,681.50	7,311	0.0180	0.0310	0.0234
R01M	155.25	66	0.0280	0.0350	0.0305
R02D	239.48	43	0.0230	0.0300	0.0258
R02M	180.19	57	0.0280	0.0360	0.0326
R03D	15,694.96	3,611	0.0180	0.0320	0.0231
R03M	74.41	37	0.0290	0.0360	0.0330
R04M	2.70	2	0.0310	0.0325	0.0318
R06M	8.20	2	0.0320	0.0340	0.0333
R07D	6,141.27	2,513	0.0225	0.0350	0.0266
R14D	1,172.70	444	0.0235	0.0337	0.0275
R21D	78.31	80	0.0268	0.0350	0.0311
合计	56,428.97	14,166	0.0180	0.0360	0.0290