

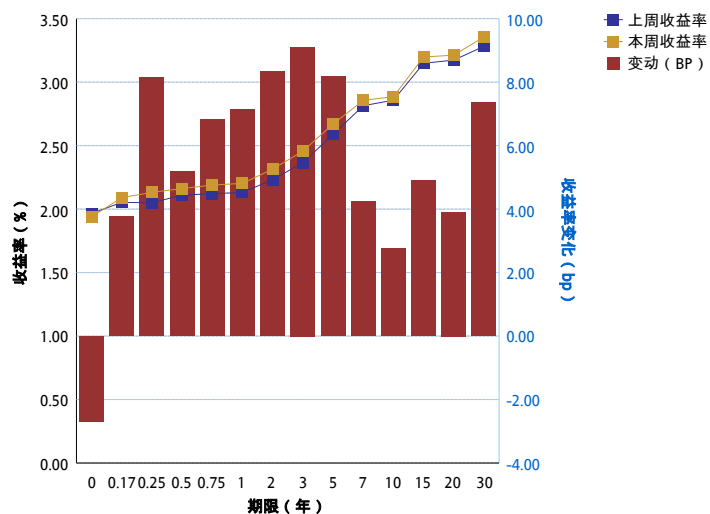
指数20161114--20161121

指数名称	指标名称	20161121	20161114	变化率(%)	上涨点数
中债-综合指数	净价指数	104.1913	104.5308	-0.32	-0.3395
中债-综合指数	平均市值法久期	4.0780	4.0844	-0.16	-0.0064
中债-综合指数	财富指数	179.8191	180.2516	-0.24	-0.4325

收益率曲线变动情况20161114-20161121

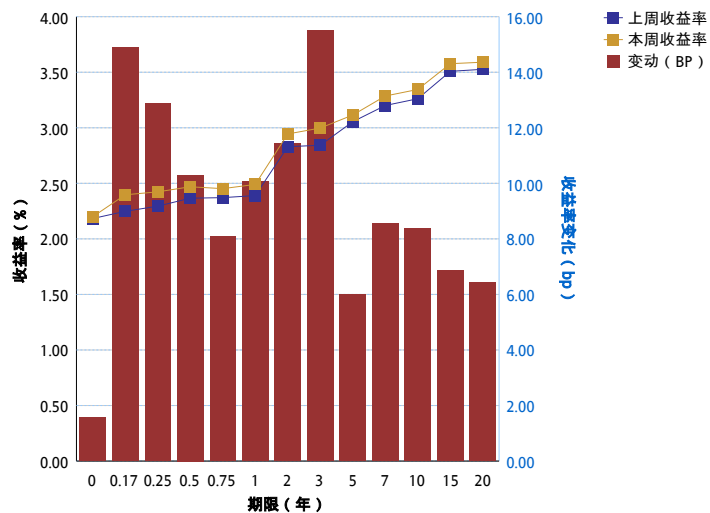
1.中债国债收益率曲线关键期限比较

期限 (年)	20161114	20161121	变动 (bp)
0.00	1.9653	1.9384	-2.69
0.17	2.0529	2.0906	3.76
0.25	2.0500	2.1316	8.16
0.50	2.1101	2.1620	5.19
0.75	2.1212	2.1894	6.82
1.00	2.1313	2.2027	7.14
2.00	2.2314	2.3147	8.33
3.00	2.3656	2.4567	9.11
5.00	2.5877	2.6694	8.17
7.00	2.8143	2.8566	4.24
10.00	2.8577	2.8851	2.74
15.00	3.1486	3.1977	4.91
20.00	3.1736	3.2127	3.91
30.00	3.2825	3.3560	7.35
平均	2.4923	2.5474	5.51



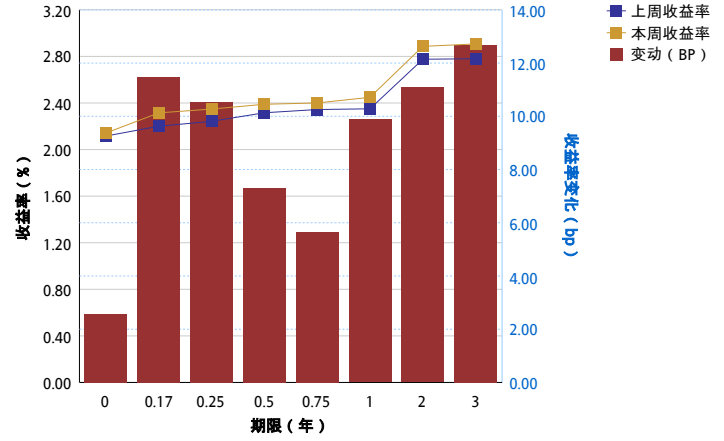
2.政策性银行债收益率曲线关键期限点比较

期限 (年)	20161114	20161121	变动 (bp)
0.00	2.1832	2.1989	1.57
0.17	2.2481	2.3970	14.90
0.25	2.2945	2.4233	12.88
0.50	2.3661	2.4692	10.30
0.75	2.3712	2.4522	8.09
1.00	2.3897	2.4903	10.06
2.00	2.8300	2.9443	11.43
3.00	2.8426	2.9977	15.51
5.00	3.0549	3.1150	6.01
7.00	3.2006	3.2861	8.55
10.00	3.2617	3.3453	8.36
15.00	3.5084	3.5768	6.85
20.00	3.5263	3.5905	6.42
平均	2.7752	2.8682	9.30



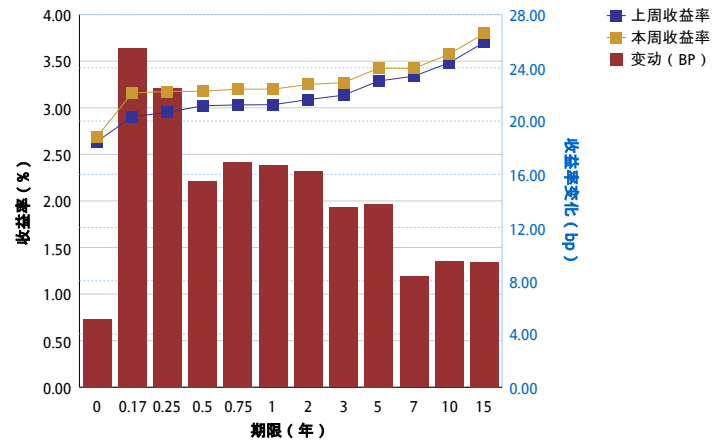
3.央票收益率曲线关键期限点比较

期限 (年)	20161114	20161121	变动 (bp)
0.00	2.1161	2.1418	2.57
0.17	2.2003	2.3150	11.47
0.25	2.2424	2.3479	10.55
0.50	2.3160	2.3890	7.30
0.75	2.3437	2.4003	5.66
1.00	2.3500	2.4488	9.88
2.00	2.7756	2.8864	11.08
3.00	2.7800	2.9069	12.69
平均	2.3905	2.4795	8.90



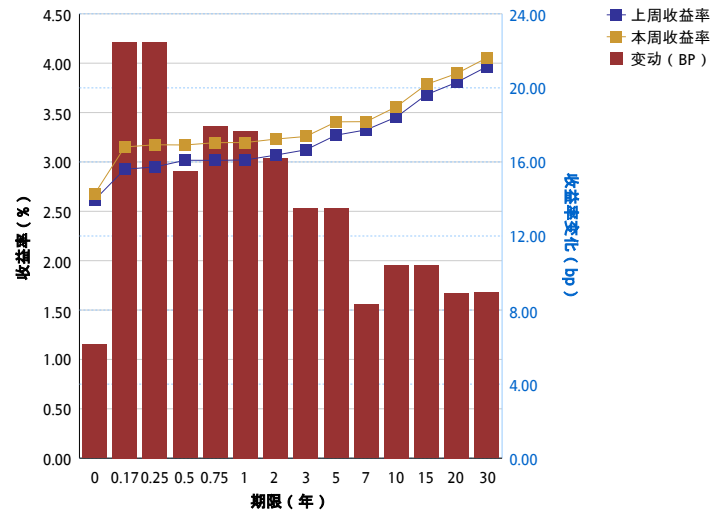
4.AAA中短期票据收益率曲线关键期限点比较

期限 (年)	20161114	20161121	变动 (bp)
0.00	2.6379	2.6893	5.14
0.17	2.9049	3.1597	25.49
0.25	2.9500	3.1749	22.49
0.50	3.0218	3.1768	15.50
0.75	3.0308	3.2000	16.92
1.00	3.0333	3.2000	16.67
2.00	3.0880	3.2501	16.21
3.00	3.1356	3.2707	13.52
5.00	3.2876	3.4255	13.79
7.00	3.3398	3.4228	8.31
10.00	3.4825	3.5768	9.43
15.00	3.7045	3.7988	9.43
平均	3.1347	3.2788	14.41



5.AAA企业债收益率曲线关键期限点比较

期限 (年)	20161114	20161121	变动 (bp)
0.00	2.6141	2.6755	6.14
0.17	2.9264	3.1513	22.48
0.25	2.9490	3.1739	22.48
0.50	3.0169	3.1719	15.50
0.75	3.0160	3.1952	17.92
1.00	3.0200	3.1967	17.67
2.00	3.0694	3.2315	16.21
3.00	3.1226	3.2578	13.52
5.00	3.2710	3.4060	13.50
7.00	3.3252	3.4081	8.29
10.00	3.4549	3.5593	10.44
15.00	3.6820	3.7862	10.42
20.00	3.8064	3.8957	8.93
30.00	3.9654	4.0548	8.94
平均	3.2314	3.3688	13.75



市场交易概览20161114--20161121

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	9,110.95	-2.49	11,826	3.22
2	质押式回购	50,699.32	-10.15	13,370	-5.62
3	买断式回购	2,344.90	-8.40	2,462	6.67
4	远期交割	-	-	-	-
5	债券借贷	282.65	12.12	145	6.62
汇总		62,437.82	-2.23	27,803	2.72

现券交易情况20161114--20161121

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	0.20	-95.56	2	-77.78
中期票据	100.12	10.11	154	20.31
二级资本工具	36.58	-15.81	43	48.28
保险公司金融债	41.80	-	11	-
商业银行债券	102.56	192.41	69	68.29
地方企业债	781.94	2.96	1,354	2.19
地方政府债	288.40	4.87	175	27.74
扶贫专项金融债	26.70	-83.24	9	-72.73
政府支持机构债	32.60	-52.96	39	8.33
政策性银行债券	6,196.62	0.86	7,979	7.00
记账式国债	1,438.56	-15.80	1,896	-13.31
资产支持证券	2.50	43.68	4	0.00
集合企业债	0.40	-66.67	2	0.00
非银行金融机构债	29.86	117.97	33	106.25
项目收益债券	32.10	-13.71	56	5.66
合计	9,110.95	2.08	11,826	9.30

质押式回购交易情况20161114--20161121

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	29,049.85	6,811	0.0180	0.0340	0.0239
R01M	134.84	59	0.0285	0.0450	0.0313
R02D	37.24	33	0.0230	0.0300	0.0273
R02M	243.32	76	0.0285	0.0410	0.0339
R03D	14,117.34	3,355	0.0180	0.0320	0.0239
R03M	178.71	44	0.0295	0.0380	0.0339
R04M	14.35	10	0.0335	0.0395	0.0358
R06M	0.40	1	0.0345	0.0345	0.0345
R07D	5,272.34	2,306	0.0225	0.0355	0.0283
R14D	1,458.62	564	0.0245	0.0370	0.0317
R21D	192.33	111	0.0290	0.0390	0.0335
合计	50,699.32	13,370	0.0180	0.0450	0.0307