

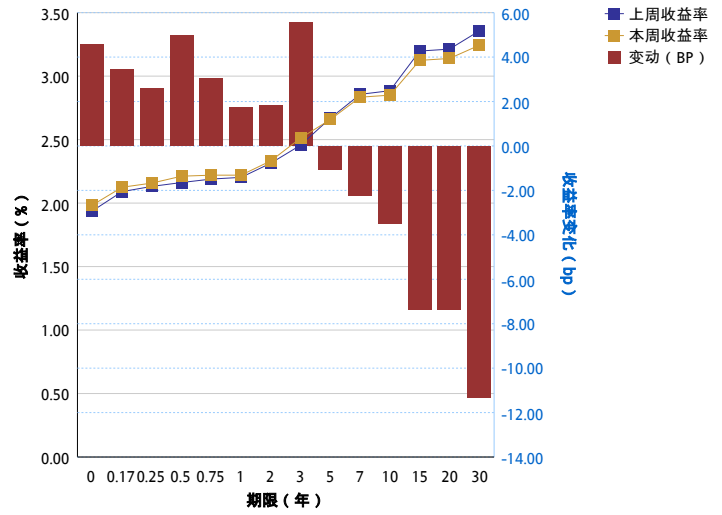
指数20161121--20161128

指数名称	指标名称	20161128	20161121	变化率(%)	上涨点数
中债-综合指数	净价指数	104.1782	104.1913	-0.01	-0.0131
中债-综合指数	平均市值法久期	4.0835	4.0780	0.13	0.0055
中债-综合指数	财富指数	179.9459	179.8191	0.07	0.1268

收益率曲线变动情况20161121-20161128

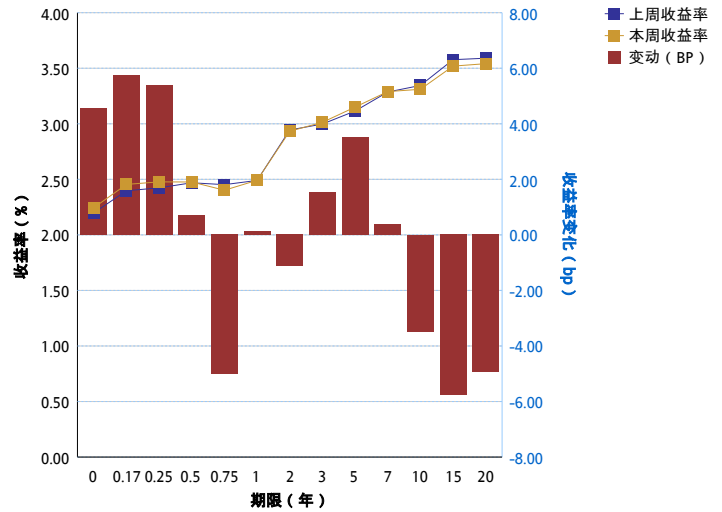
1.中债国债收益率曲线关键期限比较

期限 (年)	20161121	20161128	变动 (bp)
0.00	1.9384	1.9840	4.56
0.17	2.0906	2.1248	3.43
0.25	2.1316	2.1577	2.61
0.50	2.1620	2.2119	4.99
0.75	2.1894	2.2199	3.04
1.00	2.2027	2.2200	1.73
2.00	2.3147	2.3331	1.84
3.00	2.4567	2.5122	5.55
5.00	2.6694	2.6587	-1.07
7.00	2.8566	2.8342	-2.25
10.00	2.8851	2.8502	-3.49
15.00	3.1977	3.1242	-7.35
20.00	3.2127	3.1392	-7.35
30.00	3.3560	3.2428	-11.32
平均	2.5474	2.5438	-0.36



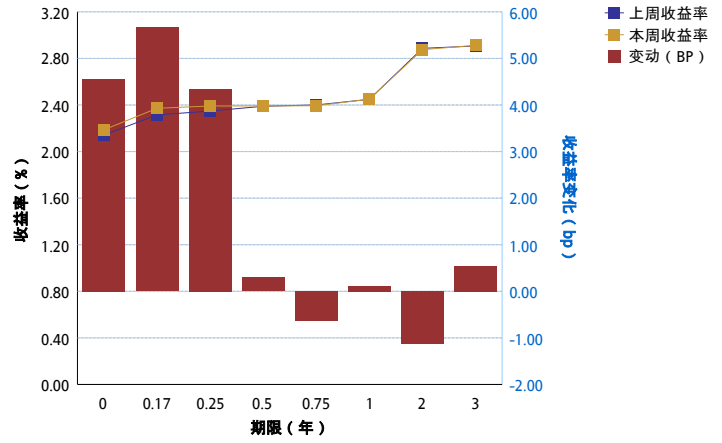
2.政策性银行债收益率曲线关键期限点比较

期限 (年)	20161121	20161128	变动 (bp)
0.00	2.1989	2.2445	4.56
0.17	2.3970	2.4544	5.73
0.25	2.4233	2.4771	5.38
0.50	2.4692	2.4760	0.68
0.75	2.4522	2.4021	-5.01
1.00	2.4903	2.4915	0.12
2.00	2.9443	2.9331	-1.12
3.00	2.9977	3.0131	1.54
5.00	3.1150	3.1500	3.50
7.00	3.2861	3.2897	0.36
10.00	3.3453	3.3106	-3.47
15.00	3.5768	3.5192	-5.76
20.00	3.5905	3.5411	-4.94
平均	2.8682	2.8694	0.12



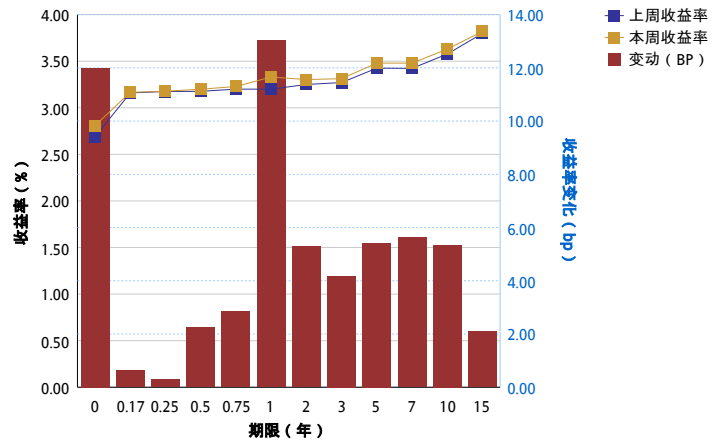
3.央票收益率曲线关键期限点比较

期限 (年)	20161121	20161128	变动 (bp)
0.00	2.1418	2.1874	4.56
0.17	2.3150	2.3716	5.66
0.25	2.3479	2.3913	4.34
0.50	2.3890	2.3920	0.30
0.75	2.4003	2.3940	-0.63
1.00	2.4488	2.4500	0.12
2.00	2.8864	2.8752	-1.12
3.00	2.9069	2.9123	0.54
平均	2.4795	2.4967	1.72



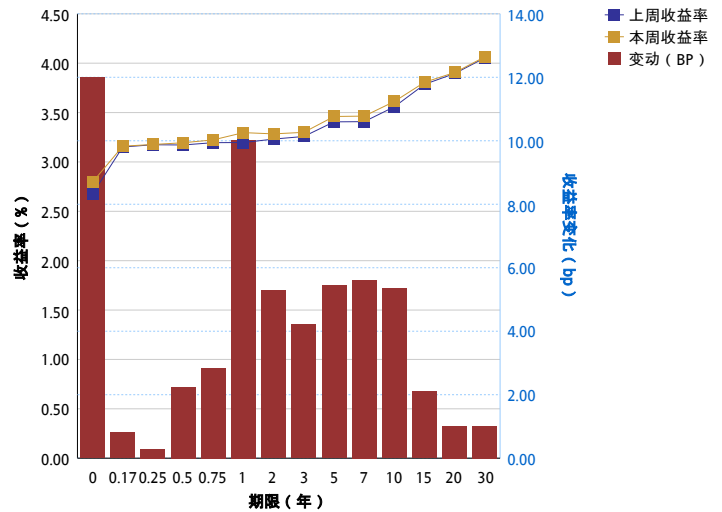
4.AAA中期票据收益率曲线关键期限点比较

期限 (年)	20161121	20161128	变动 (bp)
0.00	2.6893	2.8093	12.00
0.17	3.1597	3.1661	0.64
0.25	3.1749	3.1778	0.29
0.50	3.1768	3.1992	2.24
0.75	3.2000	3.2284	2.84
1.00	3.2000	3.3303	13.03
2.00	3.2501	3.3029	5.28
3.00	3.2707	3.3125	4.18
5.00	3.4255	3.4797	5.43
7.00	3.4228	3.4791	5.62
10.00	3.5768	3.6303	5.35
15.00	3.7988	3.8198	2.10
平均	3.2788	3.3280	4.92



5.AAA企业债收益率曲线关键期限点比较

期限 (年)	20161121	20161128	变动 (bp)
0.00	2.6755	2.7955	12.00
0.17	3.1513	3.1593	0.81
0.25	3.1739	3.1768	0.29
0.50	3.1719	3.1943	2.24
0.75	3.1952	3.2236	2.84
1.00	3.1967	3.2970	10.03
2.00	3.2315	3.2843	5.28
3.00	3.2578	3.3000	4.22
5.00	3.4060	3.4603	5.43
7.00	3.4081	3.4643	5.62
10.00	3.5593	3.6128	5.35
15.00	3.7862	3.8072	2.10
20.00	3.8957	3.9059	1.02
30.00	4.0548	4.0650	1.02
平均	3.3688	3.4105	4.16



市场交易概览20161121--20161128

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	9,467.67	3.92	11,045	-6.60
2	质押式回购	54,021.04	6.55	14,288	6.87
3	买断式回购	2,651.85	13.09	2,581	4.83
4	远期交割	-	-	-	-
5	债券借贷	247.26	-12.52	115	-20.69
汇总		66,387.82	2.76	28,029	-3.90

现券交易情况20161121--20161128

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	14.60	7,200.00	22	1,000.00
中期票据	130.79	30.63	209	35.71
二级资本工具	38.88	6.29	56	30.23
保险公司金融债	30.00	-28.23	19	72.73
商业银行债券	76.72	-25.20	65	-5.80
地方企业债	837.02	7.04	1,558	15.07
地方政府债	487.60	69.07	185	5.71
政府支持机构债	74.00	126.99	91	133.33
政策性银行债券	6,036.56	-2.58	6,721	-15.77
记账式国债	1,663.00	15.60	2,017	6.38
资产支持证券	9.28	271.12	20	400.00
集合企业债	1.30	225.00	1	-50.00
非银行金融机构债	41.50	38.97	27	-18.18
项目收益债券	26.42	-17.69	54	-3.57
合计	9,467.67	565.50	11,045	114.70

质押式回购交易情况20161121--20161128

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	31,192.52	7,601	0.0212	0.0360	0.0240
R01M	123.87	33	0.0285	0.0360	0.0316
R01Y	1.00	1	0.0357	0.0357	0.0357
R02D	154.44	78	0.0234	0.0330	0.0272
R02M	76.73	39	0.0285	0.0410	0.0338
R03D	15,297.37	3,636	0.0180	0.0360	0.0240
R03M	144.85	38	0.0295	0.0390	0.0363
R04M	7.86	5	0.0330	0.0385	0.0349
R06M	1.60	2	0.0345	0.0355	0.0350
R07D	5,765.80	2,310	0.0225	0.0397	0.0298
R09M	1.00	2	0.0365	0.0375	0.0370
R14D	1,160.27	485	0.0245	0.0360	0.0327
R21D	93.73	58	0.0248	0.0360	0.0332
合计	54,021.04	14,288	0.0180	0.0410	0.0319