

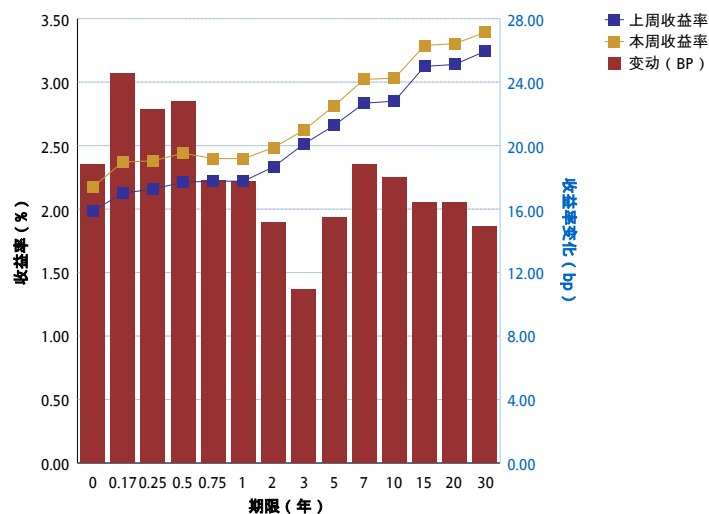
指数20161128--20161205

指数名称	指标名称	20161205	20161128	变化率(%)	上涨点数
中债-综合指数	净价指数	103.2707	104.1782	-0.87	-0.9075
中债-综合指数	平均市值法久期	4.0298	4.0835	-1.32	-0.0537
中债-综合指数	财富指数	178.5508	179.9459	-0.78	-1.3951

收益率曲线变动情况20161128-20161205

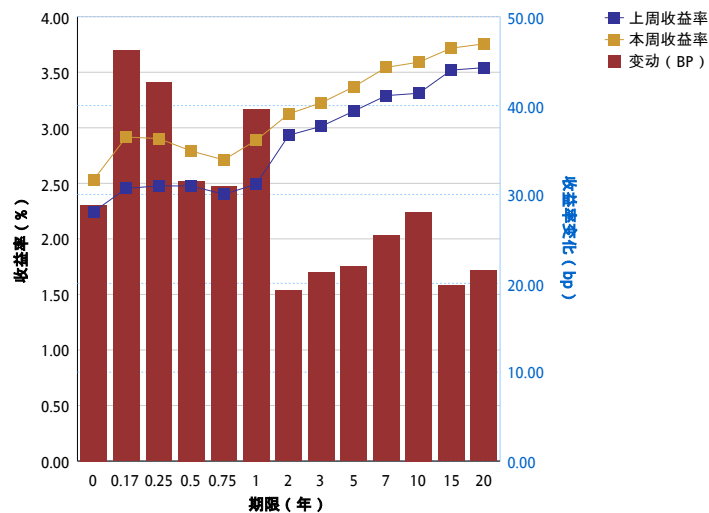
1.中债国债收益率曲线关键期限比较

期限 (年)	20161128	20161205	变动 (bp)
0.00	1.9840	2.1722	18.82
0.17	2.1248	2.3703	24.54
0.25	2.1577	2.3805	22.29
0.50	2.2119	2.4396	22.77
0.75	2.2199	2.3981	17.82
1.00	2.2200	2.3974	17.74
2.00	2.3331	2.4846	15.16
3.00	2.5122	2.6216	10.94
5.00	2.6587	2.8131	15.44
7.00	2.8342	3.0222	18.80
10.00	2.8502	3.0302	18.00
15.00	3.1242	3.2883	16.41
20.00	3.1392	3.3033	16.41
30.00	3.2428	3.3917	14.89
平均	2.5438	2.7224	17.86



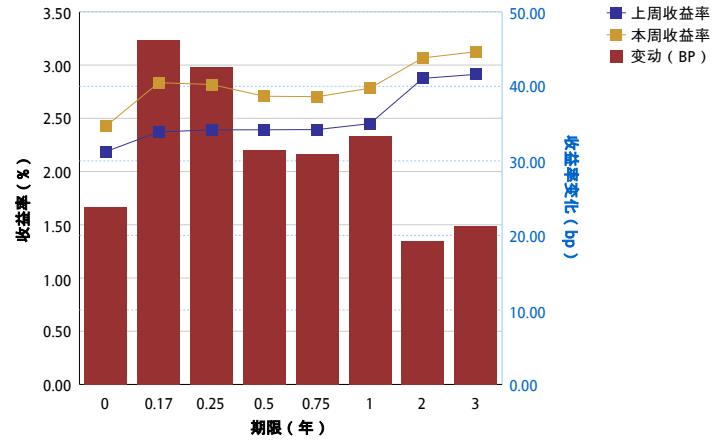
2.政策性银行债收益率曲线关键期限点比较

期限 (年)	20161128	20161205	变动 (bp)
0.00	2.2445	2.5327	28.82
0.17	2.4544	2.9168	46.24
0.25	2.4771	2.9032	42.61
0.50	2.4760	2.7912	31.52
0.75	2.4021	2.7111	30.90
1.00	2.4915	2.8877	39.62
2.00	2.9331	3.1253	19.22
3.00	3.0131	3.2252	21.21
5.00	3.1500	3.3689	21.88
7.00	3.2897	3.5438	25.41
10.00	3.3106	3.5908	28.02
15.00	3.5192	3.7169	19.77
20.00	3.5411	3.7555	21.44
平均	2.8694	3.1592	28.97



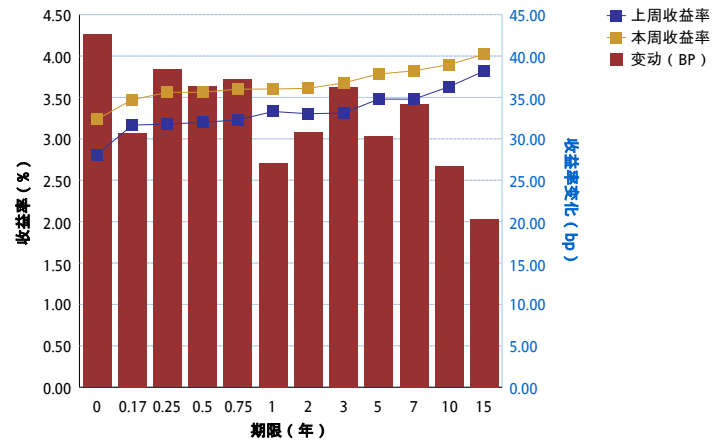
3.央票收益率曲线关键期限点比较

期限 (年)	20161128	20161205	变动 (bp)
0.00	2.1874	2.4256	23.82
0.17	2.3716	2.8344	46.28
0.25	2.3913	2.8174	42.61
0.50	2.3920	2.7072	31.52
0.75	2.3940	2.7030	30.90
1.00	2.4500	2.7828	33.28
2.00	2.8752	3.0674	19.22
3.00	2.9123	3.1244	21.21
平均	2.4967	2.8078	31.10



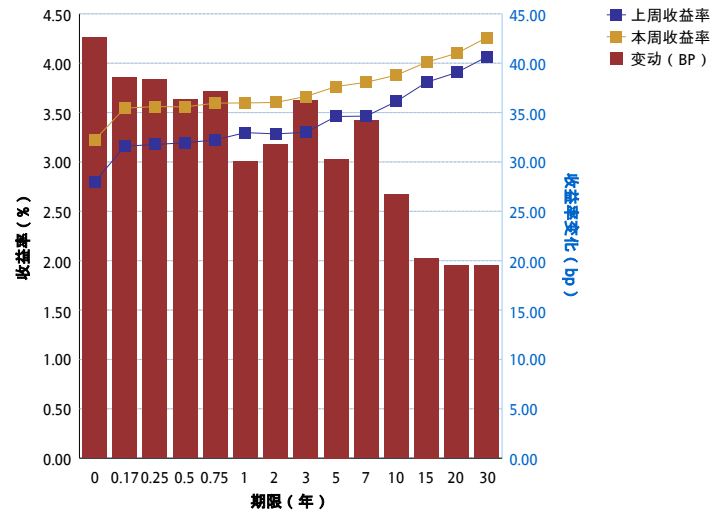
4.AAA中短期票据收益率曲线关键期限点比较

期限 (年)	20161128	20161205	变动 (bp)
0.00	2.8093	3.2352	42.59
0.17	3.1661	3.4729	30.68
0.25	3.1778	3.5613	38.35
0.50	3.1992	3.5625	36.33
0.75	3.2284	3.6000	37.16
1.00	3.3303	3.6010	27.07
2.00	3.3029	3.6104	30.75
3.00	3.3125	3.6752	36.27
5.00	3.4797	3.7827	30.30
7.00	3.4791	3.8213	34.22
10.00	3.6303	3.8972	26.68
15.00	3.8198	4.0227	20.29
平均	3.3280	3.6535	32.56



5.AAA企业债收益率曲线关键期限点比较

期限 (年)	20161128	20161205	变动 (bp)
0.00	2.7955	3.2213	42.58
0.17	3.1593	3.5450	38.57
0.25	3.1768	3.5603	38.35
0.50	3.1943	3.5576	36.33
0.75	3.2236	3.5952	37.16
1.00	3.2970	3.5977	30.07
2.00	3.2843	3.6023	31.80
3.00	3.3000	3.6627	36.27
5.00	3.4603	3.7633	30.30
7.00	3.4643	3.8065	34.22
10.00	3.6128	3.8797	26.69
15.00	3.8072	4.0101	20.29
20.00	3.9059	4.1008	19.49
30.00	4.0650	4.2599	19.49
平均	3.4105	3.7259	31.54



市场交易概览20161128--20161205

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	9,300.63	-1.76	12,082	9.39
2	质押式回购	53,393.56	-1.16	13,732	-3.89
3	买断式回购	2,682.98	1.17	2,846	10.27
4	远期交割	-	-	-	-
5	债券借贷	631.80	155.52	123	6.96
汇总		66,008.98	38.44	28,783	5.68

现券交易情况20161128--20161205

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	13.30	-8.90	25	13.64
中期票据	112.24	-14.18	182	-12.92
二级资本工具	31.52	-18.93	43	-23.21
保险公司金融债	25.00	-16.67	20	5.26
商业银行债券	69.26	-9.73	52	-20.00
地方企业债	758.64	-9.36	1,461	-6.23
地方政府债	358.20	-26.54	176	-4.86
扶贫专项金融债	1.90	-	4	-
政府支持机构债	43.92	-40.65	60	-34.07
政策性银行债券	6,190.43	2.55	8,079	20.21
记账式国债	1,618.54	-2.67	1,873	-7.14
资产支持证券	33.04	256.11	42	110.00
集合企业债	17.75	1,265.38	34	3,300.00
非银行金融机构债	8.20	-80.24	6	-77.78
项目收益债券	18.69	-29.27	25	-53.70
合计	9,300.63	90.49	12,082	229.23

质押式回购交易情况20161128--20161205

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	30,094.35	7,060	0.0180	0.0600	0.0239
R01M	271.71	106	0.0290	0.0500	0.0371
R02D	53.06	44	0.0200	0.0324	0.0256
R02M	178.31	76	0.0285	0.0500	0.0408
R03D	15,555.28	3,514	0.0160	0.0380	0.0235
R03M	140.63	63	0.0295	0.0500	0.0412
R04M	2.00	1	0.0405	0.0405	0.0405
R06M	9.50	5	0.0380	0.0400	0.0392
R07D	5,976.86	2,426	0.0225	0.0600	0.0299
R14D	1,041.08	396	0.0240	0.0500	0.0336
R21D	70.80	41	0.0286	0.0410	0.0339
合计	53,393.56	13,732	0.0160	0.0600	0.0336