

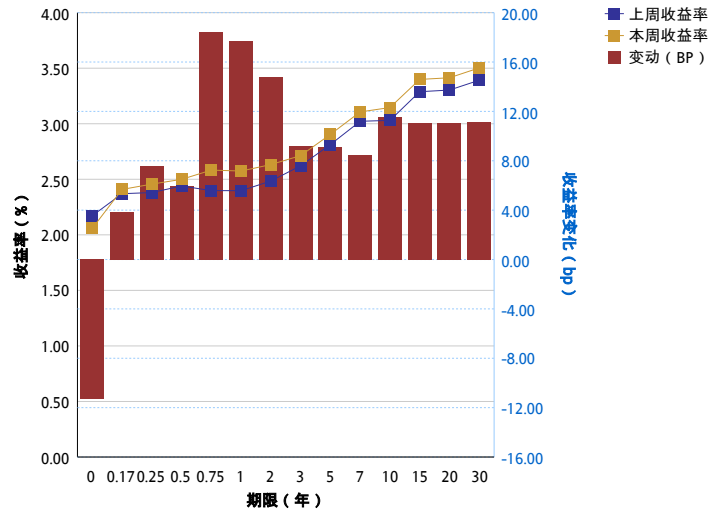
## 指数20161205--20161212

指数名称	指标名称	20161212	20161205	变化率(%)	上涨点数
中债-综合指数	净价指数	102.6787	103.2707	-0.57	-0.5920
中债-综合指数	平均市值法久期	3.9979	4.0298	-0.79	-0.0319
中债-综合指数	财富指数	177.6906	178.5508	-0.48	-0.8602

# 收益率曲线变动情况20161205-20161212

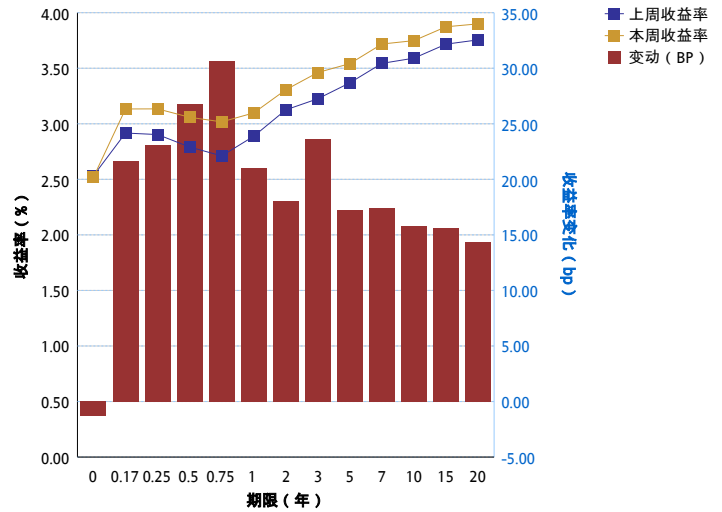
## 1.中债国债收益率曲线关键期限比较

期限 (年)	20161205	20161212	变动 (bp)
0.00	2.1722	2.0592	-11.30
0.17	2.3703	2.4089	3.86
0.25	2.3805	2.4564	7.59
0.50	2.4396	2.4995	5.99
0.75	2.3981	2.5825	18.45
1.00	2.3974	2.5744	17.70
2.00	2.4846	2.6325	14.79
3.00	2.6216	2.7132	9.16
5.00	2.8131	2.9043	9.12
7.00	3.0222	3.1067	8.45
10.00	3.0302	3.1458	11.56
15.00	3.2883	3.3989	11.06
20.00	3.3033	3.4139	11.06
30.00	3.3917	3.5027	11.10
平均	<b>2.7224</b>	<b>2.8142</b>	<b>9.19</b>



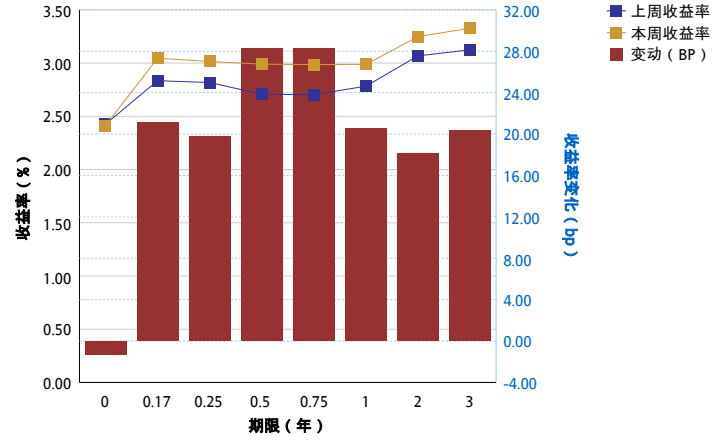
## 2.政策性银行债收益率曲线关键期限点比较

期限 (年)	20161205	20161212	变动 (bp)
0.00	2.5327	2.5197	-1.30
0.17	2.9168	3.1335	21.67
0.25	2.9032	3.1343	23.11
0.50	2.7912	3.0587	26.75
0.75	2.7111	3.0175	30.64
1.00	2.8877	3.0978	21.01
2.00	3.1253	3.3062	18.09
3.00	3.2252	3.4616	23.64
5.00	3.3689	3.5416	17.27
7.00	3.5438	3.7178	17.40
10.00	3.5908	3.7486	15.78
15.00	3.7169	3.8732	15.63
20.00	3.7555	3.8995	14.40
平均	<b>3.1592</b>	<b>3.3469</b>	<b>18.78</b>



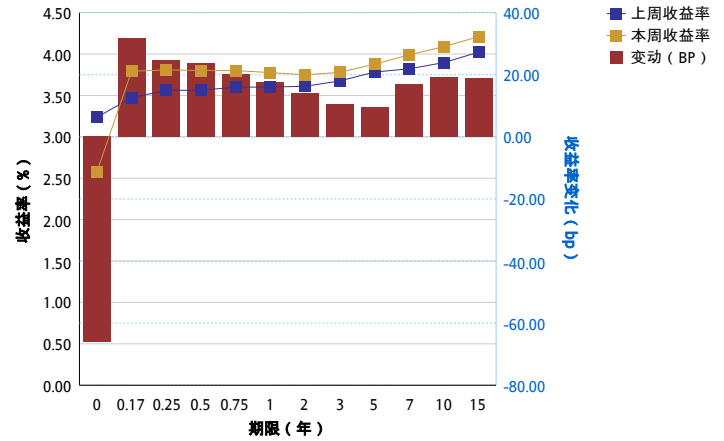
## 3.央票收益率曲线关键期限点比较

期限 (年)	20161205	20161212	变动 (bp)
0.00	2.4256	2.4126	-1.30
0.17	2.8344	3.0452	21.08
0.25	2.8174	3.0154	19.80
0.50	2.7072	2.9898	28.26
0.75	2.7030	2.9857	28.27
1.00	2.7828	2.9878	20.50
2.00	3.0674	3.2483	18.09
3.00	3.1244	3.3275	20.31
平均	<b>2.8078</b>	<b>3.0015</b>	<b>19.38</b>



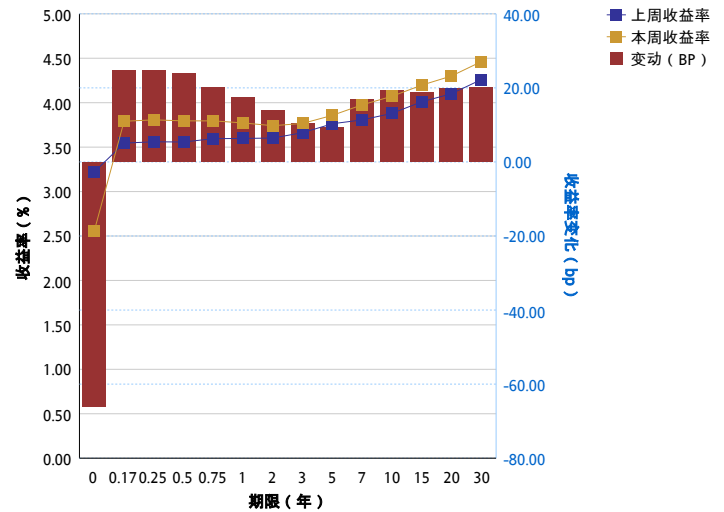
4.AAA中短期票据收益率曲线关键期限点比较

期限 (年)	20161205	20161212	变动 (bp)
0.00	3.2352	2.5740	-66.12
0.17	3.4729	3.7916	31.88
0.25	3.5613	3.8080	24.67
0.50	3.5625	3.8004	23.79
0.75	3.6000	3.8002	20.02
1.00	3.6010	3.7757	17.47
2.00	3.6104	3.7493	13.89
3.00	3.6752	3.7794	10.42
5.00	3.7827	3.8771	9.44
7.00	3.8213	3.9910	16.97
10.00	3.8972	4.0895	19.23
15.00	4.0227	4.2098	18.71
平均	<b>3.6535</b>	<b>3.7705</b>	<b>11.70</b>



5.AAA企业债收益率曲线关键期限点比较

期限 (年)	20161205	20161212	变动 (bp)
0.00	3.2213	2.5602	-66.11
0.17	3.5450	3.7909	24.59
0.25	3.5603	3.8070	24.67
0.50	3.5576	3.7955	23.79
0.75	3.5952	3.7954	20.02
1.00	3.5977	3.7724	17.47
2.00	3.6023	3.7412	13.89
3.00	3.6627	3.7669	10.42
5.00	3.7633	3.8577	9.44
7.00	3.8065	3.9762	16.97
10.00	3.8797	4.0719	19.22
15.00	4.0101	4.1972	18.71
20.00	4.1008	4.3004	19.96
30.00	4.2599	4.4615	20.16
平均	<b>3.7259</b>	<b>3.8496</b>	<b>12.37</b>



## 市场交易概览20161205--20161212

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	12,247.11	31.68	12,988	7.50
2	质押式回购	60,505.96	13.32	14,008	2.01
3	买断式回购	3,067.74	14.34	2,838	-0.28
4	远期交割	-	-	-	-
5	债券借贷	302.41	-52.14	140	13.82
<b>汇总</b>		<b>76,123.22</b>	<b>1.80</b>	<b>29,974</b>	<b>5.76</b>

## 现券交易情况20161205--20161212

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	26.50	99.25	34	36.00
中期票据	183.59	63.57	351	92.86
二级资本工具	26.37	-16.35	36	-16.28
保险公司金融债	11.20	-55.20	7	-65.00
商业银行债券	84.72	22.33	72	38.46
地方企业债	1,114.60	46.92	2,314	58.38
地方政府债	420.90	17.50	186	5.68
扶贫专项金融债	25.80	1,257.89	20	400.00
政府支持机构债	115.88	163.84	106	76.67
政策性银行债券	8,180.87	32.15	8,065	-0.17
记账式国债	1,980.29	22.35	1,711	-8.65
资产支持证券	32.10	-2.85	30	-28.57
集合企业债	6.70	-62.25	14	-58.82
非银行金融机构债	27.00	229.27	20	233.33
项目收益债券	10.59	-43.34	22	-12.00
<b>合计</b>	<b>12,247.11</b>	<b>118.34</b>	<b>12,988</b>	<b>50.13</b>

## 质押式回购交易情况20161205--20161212

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	35,576.44	7,295	0.0180	0.0290	0.0228
R01M	649.00	298	0.0295	0.0530	0.0449
R01Y	1.70	2	0.0390	0.0395	0.0392
R02D	137.44	51	0.0220	0.0300	0.0251
R02M	537.38	263	0.0295	0.0520	0.0452
R03D	17,238.11	3,592	0.0180	0.0300	0.0226
R03M	221.56	76	0.0360	0.0500	0.0435
R04M	7.60	7	0.0410	0.0478	0.0435
R06M	5.60	6	0.0400	0.0410	0.0403
R07D	4,884.57	2,014	0.0225	0.0450	0.0265
R14D	1,186.70	361	0.0245	0.0333	0.0292
R21D	59.86	43	0.0270	0.0350	0.0314
<b>合计</b>	<b>60,505.96</b>	<b>14,008</b>	<b>0.0180</b>	<b>0.0530</b>	<b>0.0345</b>