

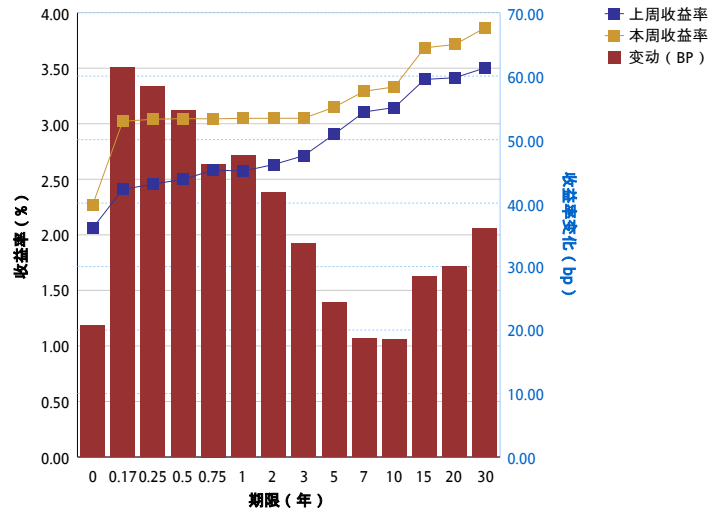
指数20161212--20161219

指数名称	指标名称	20161219	20161212	变化率(%)	上涨点数
中债-综合指数	净价指数	101.2451	102.6787	-1.40	-1.4336
中债-综合指数	平均市值法久期	3.9272	3.9979	-1.77	-0.0707
中债-综合指数	财富指数	175.3996	177.6906	-1.29	-2.2910

收益率曲线变动情况20161212-20161219

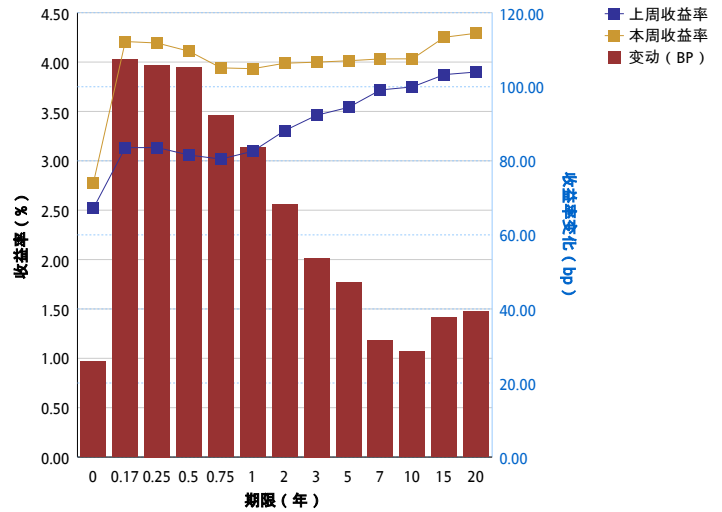
1.中债国债收益率曲线关键期限比较

期限 (年)	20161212	20161219	变动 (bp)
0.00	2.0592	2.2663	20.71
0.17	2.4089	3.0220	61.31
0.25	2.4564	3.0404	58.40
0.50	2.4995	3.0460	54.65
0.75	2.5825	3.0441	46.16
1.00	2.5744	3.0491	47.47
2.00	2.6325	3.0490	41.65
3.00	2.7132	3.0498	33.67
5.00	2.9043	3.1483	24.40
7.00	3.1067	3.2927	18.60
10.00	3.1458	3.3316	18.58
15.00	3.3989	3.6832	28.43
20.00	3.4139	3.7133	29.94
30.00	3.5027	3.8622	35.95
平均	2.8142	3.1856	37.14



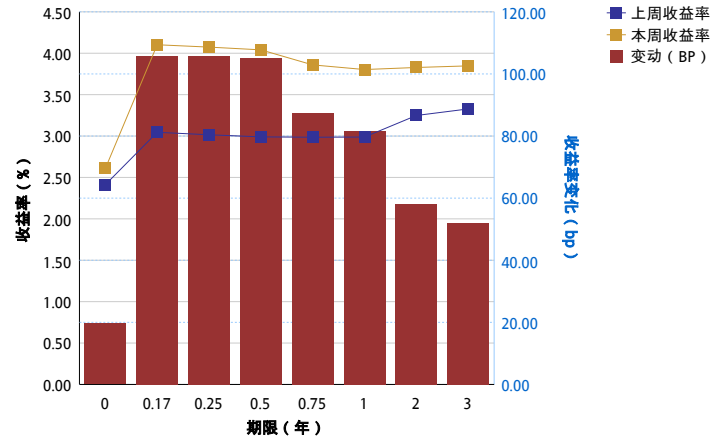
2.政策性银行债收益率曲线关键期限点比较

期限 (年)	20161212	20161219	变动 (bp)
0.00	2.5197	2.7768	25.71
0.17	3.1335	4.2083	107.48
0.25	3.1343	4.1929	105.86
0.50	3.0587	4.1097	105.11
0.75	3.0175	3.9410	92.35
1.00	3.0978	3.9330	83.52
2.00	3.3062	3.9883	68.21
3.00	3.4616	3.9991	53.76
5.00	3.5416	4.0134	47.18
7.00	3.7178	4.0318	31.40
10.00	3.7486	4.0327	28.41
15.00	3.8732	4.2512	37.80
20.00	3.8995	4.2918	39.23
平均	3.3469	3.9823	63.54



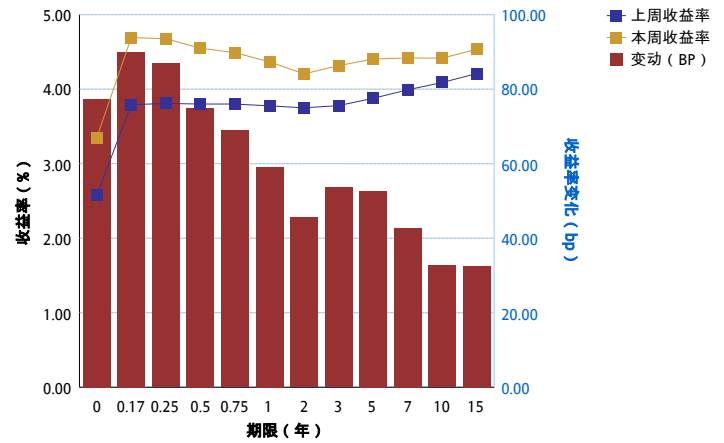
3.央票收益率曲线关键期限点比较

期限 (年)	20161212	20161219	变动 (bp)
0.00	2.4126	2.6088	19.62
0.17	3.0452	4.1024	105.72
0.25	3.0154	4.0740	105.86
0.50	2.9898	4.0408	105.10
0.75	2.9857	3.8592	87.35
1.00	2.9878	3.8030	81.52
2.00	3.2483	3.8280	57.97
3.00	3.3275	3.8475	52.00
平均	3.0015	3.7705	76.89



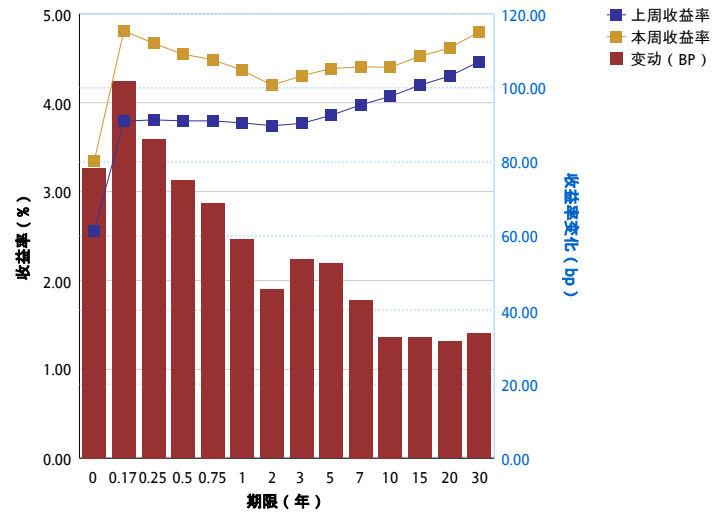
4.AAA中短期票据收益率曲线关键期限点比较

期限 (年)	20161212	20161219	变动 (bp)
0.00	2.5740	3.3479	77.39
0.17	3.7916	4.6917	90.01
0.25	3.8080	4.6768	86.88
0.50	3.8004	4.5502	74.98
0.75	3.8002	4.4891	68.89
1.00	3.7757	4.3666	59.09
2.00	3.7493	4.2044	45.51
3.00	3.7794	4.3156	53.62
5.00	3.8771	4.4037	52.66
7.00	3.9910	4.4185	42.75
10.00	4.0895	4.4163	32.68
15.00	4.2098	4.5357	32.59
平均	3.7705	4.3680	59.75



5.AAA企业债收益率曲线关键期限点比较

期限 (年)	20161212	20161219	变动 (bp)
0.00	2.5602	3.3441	78.39
0.17	3.7909	4.8085	101.76
0.25	3.8070	4.6688	86.18
0.50	3.7955	4.5453	74.98
0.75	3.7954	4.4844	68.90
1.00	3.7724	4.3633	59.09
2.00	3.7412	4.1963	45.51
3.00	3.7669	4.3032	53.63
5.00	3.8577	4.3843	52.66
7.00	3.9762	4.4037	42.75
10.00	4.0719	4.3988	32.69
15.00	4.1972	4.5231	32.59
20.00	4.3004	4.6163	31.59
30.00	4.4615	4.7974	33.59
平均	3.8496	4.4170	56.74



市场交易概览20161212--20161219

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	9,869.52	-19.41	11,153	-14.13
2	质押式回购	53,151.57	-12.15	15,321	9.37
3	买断式回购	2,759.90	-10.03	2,761	-2.71
4	远期交割	-	-	-	-
5	债券借贷	326.67	8.02	154	10.00
汇总		66,107.66	-8.40	29,389	0.63

现券交易情况20161212--20161219

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	88.50	233.96	38	11.76
中期票据	235.25	28.14	319	-9.12
二级资本工具	102.12	287.30	82	127.78
保险公司金融债	7.80	-30.36	7	0.00
商业银行债券	131.90	55.70	91	26.39
地方企业债	719.74	-35.43	1,540	-33.45
地方政府债	449.04	6.69	231	24.19
扶贫专项金融债	26.50	2.71	9	-55.00
政府支持机构债	188.00	62.24	160	50.94
政策性银行债券	5,674.12	-30.64	6,853	-15.03
记账式国债	2,166.41	9.40	1,748	2.16
证券公司债	0.30	-	1	-
资产支持证券	32.43	1.03	22	-26.67
集合企业债	0.20	-97.01	1	-92.86
非银行金融机构债	32.20	19.26	21	5.00
项目收益债券	15.00	41.67	30	36.36
合计	9,869.52	36.98	11,153	3.50

质押式回购交易情况20161212--20161219

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	30,230.17	7,902	0.0200	0.1000	0.0267
R01M	722.77	315	0.0300	0.1000	0.0651
R01Y	6.10	6	0.0465	0.0475	0.0472
R02D	224.63	120	0.0250	0.0700	0.0364
R02M	410.92	221	0.0295	0.0950	0.0580
R03D	14,643.56	3,969	0.0190	0.1000	0.0287
R03M	138.46	115	0.0450	0.0719	0.0567
R04M	7.50	5	0.0450	0.0700	0.0568
R06M	60.48	47	0.0420	0.0505	0.0485
R07D	5,794.48	2,037	0.0225	0.1100	0.0390
R09M	1.20	1	0.0480	0.0480	0.0480
R14D	537.25	307	0.0245	0.1050	0.0441
R21D	374.04	276	0.0245	0.1000	0.0588
合计	53,151.57	15,321	0.0190	0.1100	0.0472