

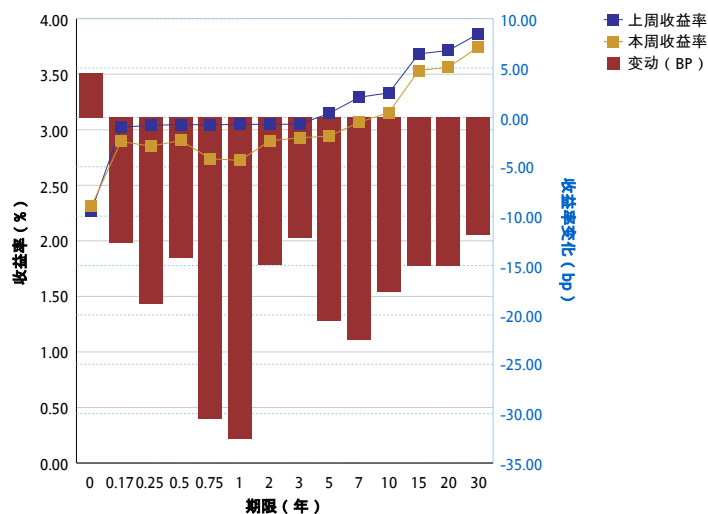
指数20161219--20161226

指数名称	指标名称	20161226	20161219	变化率(%)	上涨点数
中债-综合指数	净价指数	101.8002	101.2451	0.55	0.5551
中债-综合指数	平均市值法久期	3.9470	3.9272	0.50	0.0198
中债-综合指数	财富指数	176.4991	175.3996	0.63	1.0995

收益率曲线变动情况20161219-20161226

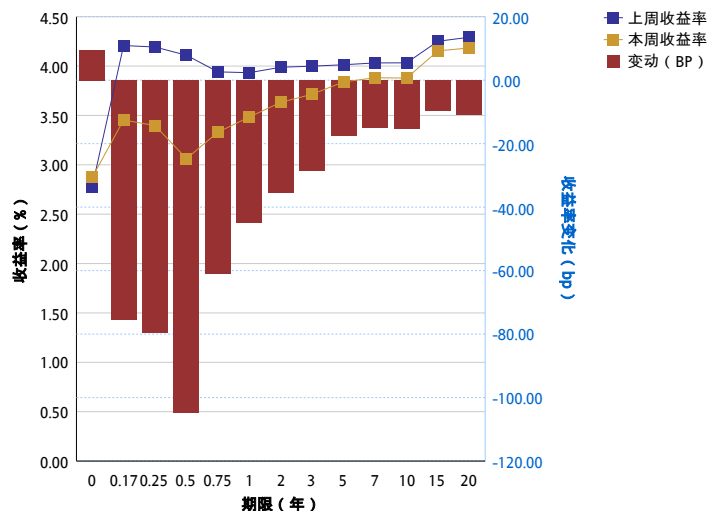
1.中债国债收益率曲线关键期限比较

期限 (年)	20161219	20161226	变动 (bp)
0.00	2.2663	2.3115	4.52
0.17	3.0220	2.8948	-12.72
0.25	3.0404	2.8517	-18.87
0.50	3.0460	2.9036	-14.24
0.75	3.0441	2.7391	-30.50
1.00	3.0491	2.7236	-32.55
2.00	3.0490	2.8999	-14.91
3.00	3.0498	2.9278	-12.20
5.00	3.1483	2.9422	-20.62
7.00	3.2927	3.0670	-22.57
10.00	3.3316	3.1551	-17.65
15.00	3.6832	3.5331	-15.01
20.00	3.7133	3.5633	-15.00
30.00	3.8622	3.7428	-11.94
平均	3.1856	3.0182	-16.73



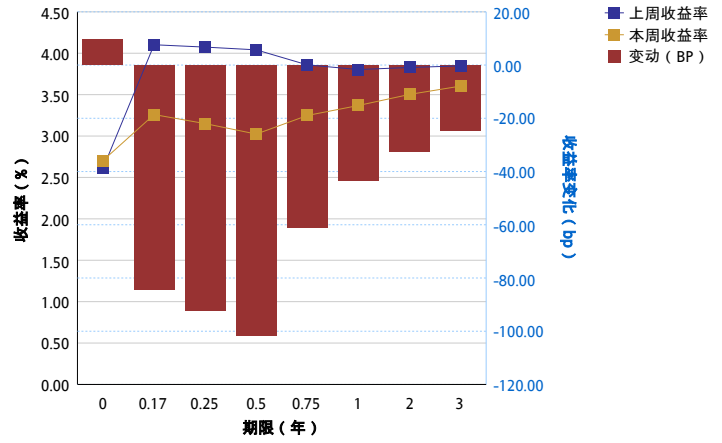
2.政策性银行债收益率曲线关键期限点比较

期限 (年)	20161219	20161226	变动 (bp)
0.00	2.7768	2.8720	9.52
0.17	4.2083	3.4534	-75.49
0.25	4.1929	3.3975	-79.54
0.50	4.1097	3.0626	-104.71
0.75	3.9410	3.3300	-61.11
1.00	3.9330	3.4845	-44.86
2.00	3.9883	3.6327	-35.56
3.00	3.9991	3.7148	-28.44
5.00	4.0134	3.8399	-17.35
7.00	4.0318	3.8816	-15.02
10.00	4.0327	3.8786	-15.41
15.00	4.2512	4.1539	-9.73
20.00	4.2918	4.1836	-10.82
平均	3.9823	3.6065	-37.58



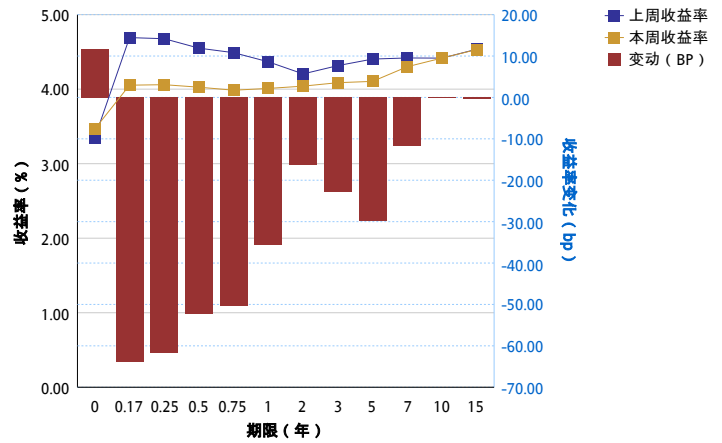
3.央票收益率曲线关键期限点比较

期限 (年)	20161219	20161226	变动 (bp)
0.00	2.6088	2.7040	9.52
0.17	4.1024	3.2595	-84.29
0.25	4.0740	3.1500	-92.40
0.50	4.0408	3.0237	-101.71
0.75	3.8592	3.2482	-61.10
1.00	3.8030	3.3692	-43.38
2.00	3.8280	3.5027	-32.53
3.00	3.8475	3.6032	-24.43
平均	3.7705	3.2326	-53.79



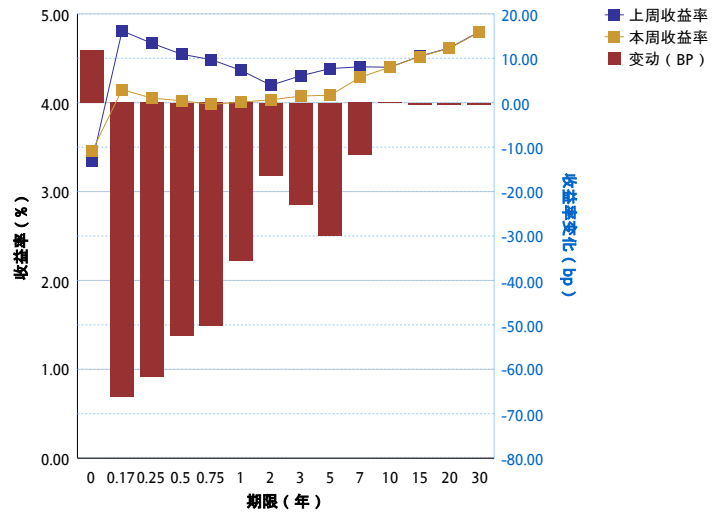
4.AAA中期票据收益率曲线关键期限点比较

期限 (年)	20161219	20161226	变动 (bp)
0.00	3.3479	3.4653	11.74
0.17	4.6917	4.0533	-63.84
0.25	4.6768	4.0600	-61.68
0.50	4.5502	4.0262	-52.40
0.75	4.4891	3.9860	-50.31
1.00	4.3666	4.0097	-35.69
2.00	4.2044	4.0403	-16.41
3.00	4.3156	4.0868	-22.89
5.00	4.4037	4.1044	-29.93
7.00	4.4185	4.3010	-11.75
10.00	4.4163	4.4170	0.08
15.00	4.5357	4.5314	-0.43
平均	4.3680	4.0901	-27.79



5.AAA企业债收益率曲线关键期限点比较

期限 (年)	20161219	20161226	变动 (bp)
0.00	3.3441	3.4615	11.74
0.17	4.8085	4.1463	-66.22
0.25	4.6688	4.0520	-61.68
0.50	4.5453	4.0213	-52.40
0.75	4.4844	3.9813	-50.31
1.00	4.3633	4.0065	-35.68
2.00	4.1963	4.0322	-16.41
3.00	4.3032	4.0744	-22.88
5.00	4.3843	4.0850	-29.93
7.00	4.4037	4.2862	-11.75
10.00	4.3988	4.3995	0.07
15.00	4.5231	4.5188	-0.43
20.00	4.6163	4.6121	-0.43
30.00	4.7974	4.7932	-0.42
平均	4.4170	4.1764	-24.05



市场交易概览20161219--20161226

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	8,004.31	-18.90	9,315	-16.48
2	质押式回购	43,375.04	-18.39	10,789	-29.58
3	买断式回购	2,427.80	-12.03	1,911	-30.79
4	远期交割	-	-	-	-
5	债券借贷	118.22	-63.81	54	-64.94
汇总		53,925.37	-28.28	22,069	-35.45

现券交易情况20161219--20161226

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	53.94	-39.05	43	13.16
中期票据	243.98	3.71	303	-5.02
二级资本工具	44.51	-56.41	35	-57.32
保险公司金融债	19.40	148.72	6	-14.29
商业银行债券	190.10	44.12	94	3.30
地方企业债	763.80	6.12	1,689	9.68
地方政府债	296.50	-33.97	131	-43.29
扶贫专项金融债	1.00	-96.23	6	-33.33
政府支持机构债	141.66	-24.65	105	-34.38
政策性银行债券	5,128.34	-9.62	5,702	-16.80
记账式国债	1,019.79	-52.93	1,100	-37.07
资产支持证券	46.60	43.67	37	68.18
集合企业债	3.50	1,650.00	2	100.00
非银行金融机构债	37.80	17.39	35	66.67
项目收益债券	13.40	-10.67	27	-10.00
合计	8,004.31	106.01	9,315	0.63

质押式回购交易情况20161219--20161226

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	22,639.36	5,111	0.0170	0.0510	0.0222
R01M	491.86	116	0.0300	0.0930	0.0437
R01Y	1.00	1	0.0450	0.0450	0.0450
R02D	141.23	40	0.0210	0.0500	0.0256
R02M	341.69	167	0.0300	0.0800	0.0542
R03D	11,231.13	2,526	0.0160	0.0350	0.0219
R03M	64.00	35	0.0360	0.0700	0.0529
R06M	0.50	1	0.0460	0.0460	0.0460
R07D	1,964.66	854	0.0210	0.0500	0.0276
R14D	5,796.84	1,683	0.0225	0.1200	0.0426
R21D	702.77	255	0.0270	0.0900	0.0511
合计	43,375.04	10,789	0.0160	0.1200	0.0393