



信达期货
CINDA FUTURES

国债期货早报20160920

联系人: 吕洁 F0269991 邵菁菁 F3014625
电话: 0571-28132630
邮箱: jingjing_shao@yahoo.com

要闻	1、惊人的8月数据：一线及二线热点城市房价暴涨 逾6年最猛上涨 2、央行旗下媒体“喊话”：地方政府应切实担负起楼市调控职责				
上海银行 间同业拆 放利率		9/18/16	9/19/16	涨跌(BP)	涨跌幅度
	0/N	2.140	2.154	1.40	0.65%
	1W	2.394	2.397	0.30	0.13%
	2W	2.522	2.531	0.90	0.36%
银行间 同业拆借 利率		9/18/16	9/19/16	涨跌(BP)	涨跌幅度
	1天	2.169	2.220	5.08	2.34%
	7天	2.558	2.510	-4.84	-1.89%
银行间 质押回购 利率		9/18/16	9/19/16	涨跌(BP)	涨跌幅度
	R001	2.203	2.273	6.93	3.15%
	R007	2.434	2.663	22.90	9.41%
上交所 质押回购 利率		9/14/16	9/19/16	涨跌(BP)	涨跌幅度
	GC001	2.420	4.765	234.50	96.90%
	GC003	0.100	2.855	275.50	2755.00%
国债 收益率		9/18/16	9/19/16	涨跌(BP)	涨跌幅度
	1Y	2.1834	2.1784	-0.50	-0.23%
	3Y	2.4480	2.4376	-1.04	-0.42%
	5Y	2.5748	2.5699	-0.49	-0.19%
	7Y	2.7612	2.7600	-0.12	-0.04%
票据利率		9/12/16	9/19/16	涨跌(BP)	涨跌幅度
	转帖6M	2.20	2.25	5.00	2.27%
	珠三角6M	2.35	2.40	5.00	2.13%
	长三角6M	2.30	2.35	5.00	2.17%
	中西部6M	2.40	2.45	5.00	2.08%
CNH HIBOR		9/15/16	9/19/16	涨跌(BP)	涨跌幅度
	隔夜	7.95	23.68	1573.00	197.86%
	7天	8.99	12.45	346.00	38.49%
最廉券		CTD	净价	IRR	基差
	TF1612	140003. IB	107.7161	1.10%	0.7476
	TF1703	110015. IB	105.8924	2.18%	0.8189
	TF1706	150014. IB	103.2288	1.88%	0.9871
	T1612	160004. IB	99.7186	3.21%	-0.0894
	T1703	160004. IB	99.7186	2.35%	0.2510
		160004. IB	99.7186	2.15%	0.5322

	收盘价	持仓量	成交量	涨跌幅度	
行情回顾	TF1612	101.440	21173	4121	0.02%
	TF1703	101.110	4323	72	0.01%
	TF1706	100.840	262	223	0.03%
	T1612	101.010	36867	11600	0.04%
	T1703	100.635	6115	280	0.06%
	T1706	100.320	438	438	0.09%
持仓建议	央行在公开市场重启14天逆回购，投资者需警惕去杠杆压力；9月通胀上行压力加大，短期期债利空因素较多，近期经济基本面边际转好利空期债，短期期债或将维持震荡。操作上，建议短期以观望为主，等待趋势进一步明确。				
报告中的信息均来源于公开可获得的资料，信达期货有限公司力求准确可靠，但对这些信息的准确性及完整性不做任何保证，据此投资，责任自负。未经信达期货有限公司授权许可，任何引用、转载以及向第三方传播本报告的行为均可能承担法律责任。					