



信达期货
CINDA FUTURES

国债期货早报20161108

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

要闻	1、“克强指数”重要指标: 10月铁路货运量创21个月新高 2、中国10月外储下降457亿美元 降幅为1月以来最大 3、煤炭涨势不减 发改委又在“憋新招”: 研究加大电煤拉运力度 4、希拉里“胜券在握” 标普大涨2% 终结九连跌				
SHIBOR		11/4/16	11/7/16	涨跌(BP)	涨跌幅度
	O/N	2.232	2.206	-2.60	-1.16%
	1W	2.405	2.399	-0.60	-0.25%
	2W	2.570	2.567	-0.30	-0.12%
	1M	2.749	2.749	0.00	0.00%
3M	2.846	2.858	1.18	0.41%	
CNH HIBOR		11/4/16	11/7/16	涨跌(BP)	涨跌幅度
	O/N	1.95	2.33	38.00	19.49%
	1W	2.85	3.16	31.00	10.88%
2W	3.04	3.30	26.00	8.55%	
银行间 同业拆借 利率		11/4/16	11/7/16	涨跌(BP)	涨跌幅度
	1D	2.277	2.250	-2.65	-1.16%
	7D	2.603	2.590	-1.27	-0.49%
	14D	2.618	2.640	2.23	0.85%
1M	3.017	3.079	6.23	2.07%	
银行间 质押回购 利率		11/4/16	11/7/16	涨跌(BP)	涨跌幅度
	R001	2.135	2.126	-0.87	-0.41%
	R007	2.426	2.421	-0.52	-0.21%
	R014	2.567	2.548	-1.90	-0.74%
R1M	2.872	2.883	1.05	0.37%	
上交所 质押回购 利率		11/4/16	11/7/16	涨跌(BP)	涨跌幅度
	GC001	1.500	1.680	18.00	12.00%
	GC003	0.400	1.870	147.00	367.50%
	GC007	2.110	2.190	8.00	3.79%
国债到期 收益率		11/4/16	11/7/16	涨跌(BP)	涨跌幅度
	1Y	2.1391	2.1451	0.60	0.28%
	3Y	2.3422	2.3581	1.59	0.68%
	5Y	2.4524	2.4663	1.39	0.57%
	7Y	2.7001	2.7161	1.60	0.59%
	10Y	2.7339	2.7475	1.36	0.50%
	20Y	3.0418	3.0649	2.31	0.76%
30Y	3.1395	3.1671	2.76	0.88%	
票据利率		11/4/16	11/7/16	涨跌(BP)	涨跌幅度
	转贴6M	2.30	2.25	-5.00	-2.17%
	珠三角6M	2.45	2.40	-5.00	-2.04%
	长三角6M	2.40	2.35	-5.00	-2.08%
	中西部6M	2.50	2.45	-5.00	-2.00%
	环渤海6M	2.55	2.50	-5.00	-1.96%

		收盘价	持仓量	成交量	涨跌幅度
国债期货 行情回顾	TF1612	101.770	13055	5677	-0.13%
	TF1703	101.340	10612	3419	-0.13%
	TF1706	101.025	1787	177	-0.11%
	T1612	101.295	25105	13000	-0.23%
	T1703	100.585	23283	8487	-0.26%
	T1706	100.090	3747	566	-0.24%
最廉券		CTD	净价	IRR	基差
	TF1612	160021. IB	97.7947	15.05%	-1.2173
	TF1703	160021. IB	97.7947	5.17%	-0.9307
	TF1706	160021. IB	97.7947	3.73%	-0.7552
	T1612	160020. IB	100.2095	-1.74%	0.4441
	T1703	160020. IB	100.2095	-0.42%	1.1031
T1706	160004. IB	100.5635	0.17%	1.6045	
持仓建议	由于 10 月 PMI 大幅超预期,短期经济数据对期债利空较多,年末前还有美联储加息预期在释放,期债承压。但四季度债市供需关系偏暖利好期债,预计四季度国债收益率将维持区间波动,操作上适合波段操作。				
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。					