



信达期货
CINDA FUTURES

国债期货早报20161116

联系人: 吕洁 F0269991 邵菁菁 F3014625

电话: 0571-28132630

邮箱: jingjing_shao@yahoo.com

要闻	1、“12月加息不会轻易动摇” 波士顿联储主席释放鹰派信号 2、OPEC联手减产希望重燃 油价反弹6% 3、高盛: 人民币到明年底会再贬6% 买“出海”中企股票 4、英国央行行长卡尼: 未来通胀将继续走高 对通胀高于目标容忍度有限				
SHIBOR		11/14/16	11/15/16	涨跌(BP)	涨跌幅度
	O/N	2.231	2.247	1.60	0.72%
	1W	2.407	2.415	0.80	0.33%
	2W	2.565	2.569	0.40	0.16%
	1M	2.751	2.751	0.03	0.01%
	3M	2.885	2.896	1.09	0.38%
CNH HIBOR		11/14/16	11/15/16	涨跌(BP)	涨跌幅度
	O/N	3.53	2.66	-87.00	-24.65%
	1W	6.05	3.81	-224.00	-37.02%
	2W	5.59	3.91	-168.00	-30.05%
银行间 同业拆借 利率		11/14/16	11/15/16	涨跌(BP)	涨跌幅度
	1D	2.274	2.277	0.32	0.14%
	7D	2.631	2.596	-3.47	-1.32%
	14D	2.721	2.749	2.76	1.01%
	1M	3.044	2.985	-5.93	-1.95%
银行间 质押回购 利率		11/14/16	11/15/16	涨跌(BP)	涨跌幅度
	R001	2.341	2.333	-0.82	-0.35%
	R007	2.630	2.728	9.82	3.73%
	R014	2.813	2.946	13.29	4.73%
	R1M	3.048	3.113	6.47	2.12%
上交所 质押回购 利率		11/14/16	11/15/16	涨跌(BP)	涨跌幅度
	GC001	2.540	2.505	-3.50	-1.38%
	GC003	2.100	4.300	220.00	104.76%
	GC007	2.600	2.900	30.00	11.54%
国债到期 收益率		11/14/16	11/15/16	涨跌(BP)	涨跌幅度
	1Y	2.1313	2.1618	3.05	1.43%
	3Y	2.3656	2.4062	4.06	1.72%
	5Y	2.5877	2.6023	1.46	0.56%
	7Y	2.8143	2.8254	1.11	0.39%
	10Y	2.8577	2.8501	-0.76	-0.27%
	20Y	3.1736	3.1886	1.50	0.47%
	30Y	3.2825	3.3205	3.80	1.16%
票据利率		11/14/16	11/15/16	涨跌(BP)	涨跌幅度
	转贴6M	2.25	2.33	8.00	3.56%
	珠三角6M	2.40	2.45	5.00	2.08%
	长三角6M	2.35	2.40	5.00	2.13%
	中西部6M	2.45	2.50	5.00	2.04%
	环渤海6M	2.50	2.55	5.00	2.00%

国债期货 行情回顾		收盘价	持仓量	成交量	涨跌幅度
	TF1612	101.570	3290	1913	0.05%
	TF1703	100.810	16710	9677	0.03%
	TF1706	100.405	2158	394	-0.01%
	T1612	100.905	5329	5604	0.04%
	T1703	99.840	44058	30800	0.14%
	T1706	99.230	5299	1414	0.05%
最廉券		CTD	净价	IRR	基差
	TF1612	160007. IB	99.9097	1.82%	0.0562
	TF1703	160007. IB	99.9097	0.42%	0.7026
	TF1706	120015. IB	103.6959	0.88%	1.4334
	T1612	160004. IB	99.5164	5.26%	-0.1878
	T1703	160004. IB	99.5164	0.29%	0.8345
	T1706	160004. IB	99.5164	0.41%	1.4077
持仓建议	10月PMI大幅超预期、通胀预期抬头，短期经济数据对期债利空较多，且特朗普意外当选美国总统，市场对全球通胀预期升温，美联储12月加息概率亦加大，导致全球债券大量遭抛售，期债承压超跌，期债前期超跌短期内或有所修复，操作上建议空单暂时离场。				
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。					