



信达期货
CINDA FUTURES

国债期货早报20161117

联系人: 吕洁 F0269991 邵菁菁 F3014625

电话: 0571-28132630

邮箱: jingjing_shao@yahoo.com

要闻	1、EIA原油库存意外大增527万桶 油价小幅反弹 2、五连降! 中国所持美债规模降至四年新低 3、在岸人民币再创八年新低 离岸跌破6.89关口 4、市场如今认为美联储几乎100%会在12月加息				
SHIBOR		11/15/16	11/16/16	涨跌(BP)	涨跌幅度
	O/N	2.247	2.257	1.00	0.45%
	1W	2.415	2.428	1.30	0.54%
	2W	2.569	2.574	0.50	0.19%
	1M	2.751	2.755	0.34	0.12%
	3M	2.896	2.913	1.70	0.59%
CNH HIBOR		11/15/16	11/16/16	涨跌(BP)	涨跌幅度
	O/N	2.66	2.74	8.00	3.01%
	1W	3.81	3.59	-22.00	-5.77%
	2W	3.91	3.70	-21.00	-5.37%
银行间 同业拆借 利率		11/15/16	11/16/16	涨跌(BP)	涨跌幅度
	1D	2.277	2.287	0.94	0.41%
	7D	2.596	2.731	13.53	5.21%
	14D	2.749	2.659	-9.00	-3.27%
	1M	2.985	3.086	10.12	3.39%
银行间 质押回购 利率		11/15/16	11/16/16	涨跌(BP)	涨跌幅度
	R001	2.333	2.378	4.49	1.92%
	R007	2.728	2.855	12.73	4.67%
	R014	2.946	3.193	24.78	8.41%
	R1M	3.113	3.043	-6.95	-2.23%
上交所 质押回购 利率		11/15/16	11/16/16	涨跌(BP)	涨跌幅度
	GC001	2.505	2.530	2.50	1.00%
	GC003	4.300	3.210	-109.00	-25.35%
	GC007	2.900	3.065	16.50	5.69%
国债到期 收益率		11/15/16	11/16/16	涨跌(BP)	涨跌幅度
	1Y	2.1618	2.1514	-1.04	-0.48%
	3Y	2.4062	2.4068	0.06	0.02%
	5Y	2.6023	2.6181	1.58	0.61%
	7Y	2.8254	2.8364	1.10	0.39%
	10Y	2.8501	2.8652	1.51	0.53%
	20Y	3.1886	3.1874	-0.12	-0.04%
	30Y	3.3205	3.3231	0.26	0.08%
票据利率		11/15/16	11/16/16	涨跌(BP)	涨跌幅度
	转贴6M	2.33	2.33	0.00	0.00%
	珠三角6M	2.45	2.45	0.00	0.00%
	长三角6M	2.40	2.40	0.00	0.00%
	中西部6M	2.50	2.50	0.00	0.00%
	环渤海6M	2.55	2.55	0.00	0.00%

国债期货 行情回顾		收盘价	持仓量	成交量	涨跌幅度
	TF1612	101.500	2828	1066	-0.05%
	TF1703	100.640	17078	7650	-0.13%
	TF1706	100.265	2241	296	-0.10%
	T1612	100.735	3725	3302	-0.14%
	T1703	99.610	44902	24200	-0.17%
	T1706	99.045	5403	639	-0.14%
最廉券		CTD	净价	IRR	基差
	TF1612	160015. IB	100.0788	1.40%	0.0911
	TF1703	160015. IB	100.0788	0.00%	0.8578
	TF1706	160015. IB	100.0788	0.64%	1.1473
	T1612	150023. IB	100.7006	2.35%	0.0462
	T1703	150023. IB	100.7006	-0.62%	1.1703
	T1706	150023. IB	100.7006	-0.04%	1.7348
持仓建议	资金面持续偏紧，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，期债弱势或将延续。				
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。					