



信达期货
CINDA FUTURES

国债期货早报20161118

联系人: 吕洁 F0269991 邵菁菁 F3014625

电话: 0571-28132630

邮箱: jingjing_shao@yahoo.com

要闻	1、监管“雷霆出击”房地产信托业务 “假股真债”成打击重点 2、人民日报: 人民币区间波动很正常 跟风兑换没必要 3、耶伦: 加息或较快到来 任期结束前不辞职 4、美国10月新屋开工飙升至九年新高				
SHIBOR		11/16/16	11/17/16	涨跌(BP)	涨跌幅度
	O/N	2.257	2.259	0.20	0.09%
	1W	2.428	2.436	0.80	0.33%
	2W	2.574	2.581	0.70	0.27%
	1M	2.755	2.761	0.63	0.23%
	3M	2.913	2.933	2.00	0.69%
CNH HIBOR		11/16/16	11/17/16	涨跌(BP)	涨跌幅度
	O/N	2.74	1.58	-116.00	-42.34%
	1W	3.59	3.44	-15.00	-4.18%
	2W	3.70	3.59	-11.00	-2.97%
银行间 同业拆借 利率		11/16/16	11/17/16	涨跌(BP)	涨跌幅度
	1D	2.287	2.286	-0.04	-0.02%
	7D	2.731	2.779	4.73	1.73%
	14D	2.659	2.749	9.03	3.40%
	1M	3.086	3.019	-6.67	-2.16%
银行间 质押回购 利率		11/16/16	11/17/16	涨跌(BP)	涨跌幅度
	R001	2.378	2.371	-0.66	-0.28%
	R007	2.855	2.808	-4.71	-1.65%
	R014	3.193	3.150	-4.34	-1.36%
	R1M	3.043	3.071	2.77	0.91%
上交所 质押回购 利率		11/16/16	11/17/16	涨跌(BP)	涨跌幅度
	GC001	2.530	4.710	218.00	86.17%
	GC003	3.210	2.490	-72.00	-22.43%
	GC007	3.065	2.600	-46.50	-15.17%
国债到期 收益率		11/16/16	11/17/16	涨跌(BP)	涨跌幅度
	1Y	2.1514	2.1813	2.99	1.39%
	3Y	2.4068	2.4318	2.50	1.04%
	5Y	2.6181	2.6638	4.57	1.75%
	7Y	2.8364	2.8517	1.53	0.54%
	10Y	2.8652	2.9055	4.03	1.41%
	20Y	3.1874	3.2337	4.63	1.45%
	30Y	3.3231	3.3784	5.53	1.66%
票据利率		11/16/16	11/17/16	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	101.305	1942	1364	-0.22%
	TF1703	100.490	19091	8310	-0.17%
	TF1706	100.115	2271	157	-0.16%
	T1612	100.460	2818	2810	-0.31%
	T1703	99.495	48027	27800	-0.19%
	T1706	98.930	5626	851	-0.17%
最廉券		CTD	净价	IRR	基差
	TF1612	160015. IB	99.9489	0.49%	0.1533
	TF1703	160015. IB	99.9489	-0.08%	0.8758
	TF1706	160015. IB	99.9489	0.60%	1.1654
	T1612	160010. IB	99.9171	0.71%	0.1577
	T1703	160010. IB	99.9171	-0.49%	1.0949
	T1706	160010. IB	99.9171	-0.05%	1.6356
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。					