



信达期货
CINDA FUTURES

国债期货早报20161122

联系人: 吕洁 F0269991 邵菁菁 F3014625

电话: 0571-28132630

邮箱: jingjing_shao@yahoo.com

要闻	1、个税改革专项抵扣临近破题: 首套房贷利率有望纳入选项 2、OPEC冻产渐行渐近 油价大涨4% 3、德拉吉: 继续宽松政策仍必要 金融稳定性风险可控 4、福岛发生7.3级强地震 日经期指刷新日低 日元上涨				
SHIBOR		11/18/16	11/21/16	涨跌(BP)	涨跌幅度
	O/N	2.265	2.271	0.60	0.26%
	1W	2.444	2.448	0.40	0.16%
	2W	2.585	2.593	0.80	0.31%
	1M	2.774	2.789	1.55	0.56%
	3M	2.951	2.970	1.96	0.66%
CNH HIBOR		11/18/16	11/21/16	涨跌(BP)	涨跌幅度
	O/N	2.02	2.19	17.00	8.42%
	1W	3.84	3.85	1.00	0.26%
	2W	3.95	3.99	4.00	1.01%
银行间 同业拆借 利率		11/18/16	11/21/16	涨跌(BP)	涨跌幅度
	1D	2.296	2.299	0.31	0.14%
	7D	2.553	2.721	16.80	6.58%
	14D	2.850	2.905	5.51	1.93%
	1M	2.982	3.227	24.55	8.23%
银行间 质押回购 利率		11/18/16	11/21/16	涨跌(BP)	涨跌幅度
	R001	2.336	2.310	-2.54	-1.09%
	R007	2.706	2.713	0.66	0.24%
	R014	3.153	3.167	1.41	0.45%
	R1M	3.089	3.158	6.86	2.22%
上交所 质押回购 利率		11/18/16	11/21/16	涨跌(BP)	涨跌幅度
	GC001	3.660	2.615	-104.50	-28.55%
	GC003	0.750	2.720	197.00	262.67%
	GC007	2.535	2.715	18.00	7.10%
国债到期 收益率		11/18/16	11/21/16	涨跌(BP)	涨跌幅度
	1Y	2.2258	2.2027	-2.31	-1.04%
	3Y	2.4463	2.4567	1.04	0.43%
	5Y	2.6582	2.6694	1.12	0.42%
	7Y	2.8573	2.8566	-0.07	-0.02%
	10Y	2.8901	2.8851	-0.50	-0.17%
	20Y	3.2189	3.2127	-0.62	-0.19%
	30Y	3.3634	3.3560	-0.74	-0.22%
票据利率		11/18/16	11/21/16	涨跌(BP)	涨跌幅度
	转贴6M	2.38	2.38	0.00	0.00%
	珠三角6M	2.48	2.48	0.00	0.00%
	长三角6M	2.43	2.43	0.00	0.00%
	中西部6M	2.53	2.53	0.00	0.00%
	环渤海6M	2.58	2.58	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	101.280	1434	342	0.02%
	TF1703	100.445	19074	6374	0.00%
	TF1706	100.050	2490	296	-0.01%
	T1612	100.495	1755	941	0.06%
	T1703	99.535	49719	17000	0.04%
	T1706	98.990	5751	391	0.07%
最廉券		CTD	净价	IRR	基差
	TF1612	160002. IB	99.5303	1.62%	0.0531
	TF1703	150007. IB	103.6218	1.35%	0.6556
	TF1706	150007. IB	103.6218	1.40%	1.1806
	T1612	150005. IB	105.1028	5.12%	-0.1058
	T1703	150005. IB	105.1028	0.31%	1.0286
	T1706	150005. IB	105.1028	0.55%	1.7172
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。					