



信达期货
CINDA FUTURES

国债期货早报20161123

联系人: 吕洁 F0269991 邵菁菁 F3014625

电话: 0571-28132630

邮箱: jingjing_shao@yahoo.com

要闻	1、市场认为美联储12月加息概率达到100% 2、伊朗伊拉克态度仍不明朗 OPEC将减产讨论推至下周 3、农行100亿打响头阵 5家国有大行“AMC”或很快落地 4、一周发生两起技术性违约 债券市场“暗流涌动”				
SHIBOR		11/21/16	11/22/16	涨跌(BP)	涨跌幅度
	O/N	2.271	2.273	0.20	0.09%
	1W	2.448	2.450	0.20	0.08%
	2W	2.593	2.597	0.40	0.15%
	1M	2.789	2.799	0.96	0.34%
	3M	2.970	2.977	0.64	0.22%
CNH HIBOR		11/21/16	11/22/16	涨跌(BP)	涨跌幅度
	O/N	2.19	1.56	-63.00	-28.77%
	1W	3.85	2.63	-122.00	-31.69%
	2W	3.99	3.08	-91.00	-22.81%
银行间 同业拆借 利率		11/21/16	11/22/16	涨跌(BP)	涨跌幅度
	1D	2.299	2.304	0.52	0.23%
	7D	2.721	2.609	-11.20	-4.12%
	14D	2.905	2.796	-10.94	-3.77%
	1M	3.227	3.185	-4.18	-1.30%
银行间 质押回购 利率		11/21/16	11/22/16	涨跌(BP)	涨跌幅度
	R001	2.310	2.315	0.46	0.20%
	R007	2.713	2.695	-1.80	-0.66%
	R014	3.167	3.197	2.96	0.93%
	R1M	3.158	3.081	-7.64	-2.42%
上交所 质押回购 利率		11/21/16	11/22/16	涨跌(BP)	涨跌幅度
	GC001	2.615	2.505	-11.00	-4.21%
	GC003	2.720	3.980	126.00	46.32%
	GC007	2.715	2.710	-0.50	-0.18%
国债到期 收益率		11/21/16	11/22/16	涨跌(BP)	涨跌幅度
	1Y	2.2027	2.1753	-2.74	-1.24%
	3Y	2.4567	2.4587	0.20	0.08%
	5Y	2.6694	2.6592	-1.02	-0.38%
	7Y	2.8566	2.8536	-0.30	-0.11%
	10Y	2.8851	2.8689	-1.62	-0.56%
	20Y	3.2127	3.2009	-1.18	-0.37%
	30Y	3.3560	3.3486	-0.74	-0.22%
票据利率		11/21/16	11/22/16	涨跌(BP)	涨跌幅度
	转贴6M	2.38	2.50	12.00	5.04%
	珠三角6M	2.48	2.60	12.00	4.84%
	长三角6M	2.43	2.55	12.00	4.94%
	中西部6M	2.53	2.65	12.00	4.74%
	环渤海6M	2.58	2.70	12.00	4.65%

国债期货 行情回顾		收盘价	持仓量	成交量	涨跌幅度
	TF1612	101.260	1297	356	0.00%
	TF1703	100.440	19600	7292	-0.02%
	TF1706	100.070	2469	576	0.00%
	T1612	100.535	1522	750	0.04%
	T1703	99.550	50037	24100	0.00%
	T1706	98.965	5781	596	-0.01%
最廉券		CTD	净价	IRR	基差
	TF1612	160007. IB	99.3866	5.35%	-0.1621
	TF1703	150007. IB	103.6005	1.38%	0.6395
	TF1706	150007. IB	103.6005	1.46%	1.4603
	T1612	150005. IB	105.0320	7.05%	-0.2181
	T1703	150005. IB	105.0320	0.55%	0.9425
	T1706	150005. IB	105.0320	0.61%	1.6730
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。					