



信达期货
CINDA FUTURES

国债期货早报20161129

联系人: 吕洁 F0269991 邵菁菁 F3014625

电话: 0571-28132630

邮箱: jingjing_shao@yahoo.com

要闻

- 1、“克强指数”重要指标: 10月铁路货运量创21个月新高
- 2、“资金荒”越发明显 中国同业存单利率和Shibor飙涨
- 3、OPEC做出最后努力争取减产落地 油价盘中刷新日高
- 4、意大利公投在即避险需求再起 黄金反弹15美元创三周最大涨幅

SHIBOR

	11/25/16	11/28/16	涨跌(BP)	涨跌幅度
O/N	2.289	2.298	0.90	0.39%
1W	2.458	2.466	0.80	0.33%
2W	2.603	2.607	0.40	0.15%
1M	2.826	2.845	1.86	0.66%
3M	3.003	3.011	0.87	0.29%

CNH HIBOR

	11/25/16	11/28/16	涨跌(BP)	涨跌幅度
O/N	1.39	1.79	40.00	28.78%
1W	3.15	3.15	0.00	0.00%
2W	3.46	3.38	-8.00	-2.31%

银行间 同业拆借 利率

	11/25/16	11/28/16	涨跌(BP)	涨跌幅度
1D	2.316	2.317	0.08	0.03%
7D	2.598	2.689	9.13	3.51%
14D	3.238	3.136	-10.19	-3.15%
1M	2.791	3.087	29.57	10.59%

银行间 质押回购 利率

	11/25/16	11/28/16	涨跌(BP)	涨跌幅度
R001	2.345	2.357	1.20	0.51%
R007	2.879	2.915	3.62	1.26%
R014	3.298	3.254	-4.39	-1.33%
R1M	3.119	3.172	5.25	1.68%

上交所 质押回购 利率

	11/24/16	11/28/16	涨跌(BP)	涨跌幅度
GC001	5.600	3.000	-260.00	-46.43%
GC003	1.060	2.905	184.50	174.06%
GC007	3.280	3.425	14.50	4.42%

国债到期 收益率

	11/25/16	11/28/16	涨跌(BP)	涨跌幅度
1Y	2.2294	2.2200	-0.94	-0.42%
3Y	2.5102	2.5122	0.20	0.08%
5Y	2.6476	2.6587	1.11	0.42%
7Y	2.8530	2.8342	-1.88	-0.66%
10Y	2.8650	2.8502	-1.48	-0.52%
20Y	3.1618	3.1392	-2.26	-0.71%
30Y	3.2734	3.2428	-3.06	-0.93%

票据利率

	11/25/16	11/28/16	涨跌(BP)	涨跌幅度
转贴6M	2.55	2.60	5.00	1.96%
珠三角6M	2.70	2.75	5.00	1.85%
长三角6M	2.65	2.70	5.00	1.89%
中西部6M	2.75	2.80	5.00	1.82%
环渤海6M	2.80	2.85	5.00	1.79%

国债期货 行情回顾		收盘价	持仓量	成交量	涨跌幅度
	TF1612	101.340	835	130	0.03%
	TF1703	100.620	19309	3206	0.04%
	TF1706	100.200	2363	94	0.04%
	T1612	100.690	606	279	0.05%
	T1703	99.595	51201	13400	0.01%
	T1706	98.920	6350	460	0.01%
最廉券		CTD	净价	IRR	基差
	TF1612	160007. IB	99.7801	-1.12%	0.1527
	TF1703	160007. IB	99.7801	-0.04%	0.7600
	TF1706	150014. IB	103.0227	0.62%	1.4299
	T1612	150005. IB	105.2182	7.92%	-0.1942
	T1703	150005. IB	105.2182	-0.07%	1.0817
	T1706	150005. IB	105.2182	0.11%	1.9062
持仓建议	近期全球通胀预期抬头且12月美联储加息预期进一步升温，导致全球债券大量遭抛售，期债亦承压超跌，或提供绝佳入场机会，中国经济短期企稳，但中长期下行压力仍然很大，预计期债前期超跌短期内会有所修复，操作上建议观望为主。				
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。					