



**信达期货**  
CINDA FUTURES

# 国债期货早报20161130

联系人: 吕洁 F0269991      邵菁菁 F3014625  
电话: 0571-28132630  
邮箱: jingjing\_shao@yahoo.com

要闻	1、出任特朗普政府交通部长 赵小兰再度出山操盘“美版四万亿” 2、经济数据向好美股恢复涨势 OPEC协议不确定油价跌近4% 3、公投临近: 欧洲央行计划“托底维稳” 意大利股债双涨 4、德银: 房地产泡沫是中国最重要的宏观问题				
SHIBOR		11/28/16	11/29/16	涨跌(BP)	涨跌幅度
	O/N	2.298	2.302	0.40	0.17%
	1W	2.466	2.481	1.50	0.61%
	2W	2.607	2.618	1.10	0.42%
	1M	2.845	2.857	1.19	0.42%
3M	3.011	3.017	0.59	0.20%	
CNH HIBOR		11/28/16	11/29/16	涨跌(BP)	涨跌幅度
	O/N	1.79	2.63	84.00	46.93%
	1W	3.15	3.09	-6.00	-1.90%
2W	3.38	3.44	6.00	1.78%	
银行间 同业拆借 利率		11/28/16	11/29/16	涨跌(BP)	涨跌幅度
	1D	2.317	2.332	1.49	0.64%
	7D	2.689	2.850	16.09	5.98%
	14D	3.136	3.384	24.76	7.89%
1M	3.087	3.083	-0.35	-0.11%	
银行间 质押回购 利率		11/28/16	11/29/16	涨跌(BP)	涨跌幅度
	R001	2.357	2.421	6.40	2.72%
	R007	2.915	3.062	14.67	5.03%
	R014	3.254	3.500	24.56	7.55%
R1M	3.172	3.379	20.67	6.52%	
上交所 质押回购 利率		11/28/16	11/29/16	涨跌(BP)	涨跌幅度
	GC001	3.000	2.580	-42.00	-14.00%
	GC003	2.905	2.790	-11.50	-3.96%
GC007	3.425	3.265	-16.00	-4.67%	
国债到期 收益率		11/28/16	11/29/16	涨跌(BP)	涨跌幅度
	1Y	2.2200	2.2599	3.99	1.80%
	3Y	2.5122	2.5525	4.03	1.60%
	5Y	2.6587	2.7096	5.09	1.91%
	7Y	2.8342	2.8900	5.58	1.97%
	10Y	2.8502	2.8906	4.04	1.42%
	20Y	3.1392	3.1742	3.50	1.11%
30Y	3.2428	3.2728	3.00	0.93%	
票据利率		11/28/16	11/29/16	涨跌(BP)	涨跌幅度
	转贴6M	2.60	2.75	15.00	5.77%
	珠三角6M	2.75	2.95	20.00	7.27%
	长三角6M	2.70	2.90	20.00	7.41%
	中西部6M	2.80	3.00	20.00	7.14%
环渤海6M	2.85	3.05	20.00	7.02%	

	收盘价	持仓量	成交量	涨跌幅度	
国债期货 行情回顾	TF1612	100.900	822	25	-0.49%
	TF1703	100.200	20345	11200	-0.42%
	TF1706	99.730	2739	940	-0.46%
	T1612	100.160	445	236	-0.54%
	T1703	98.930	53349	38482	-0.71%
	T1706	98.080	7048	2007	-0.88%
	CTD	净价	IRR	基差	
最廉券	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	<p>资金面延续紧张态势，昨日期债创出上市以来最大跌幅。全球通胀预期抬头且12月美联储加息预期进一步升温，资本外流和人民币汇率贬值压力加大，叠加国内房地产市场调控，政策重点亦转向抑制资产泡沫，短期货币政策难松，利空期债，预计期债弱势或将延续。</p>				
<p>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。</p>					