



信达期货
CINDA FUTURES

国债期货早报20170111

联系人: 吕洁 F0269991 邵菁菁 F3014625

电话: 0571-28132630

邮箱: jingjing_shao@yahoo.com

要闻	1、22个省级“两会”将于1月中旬密集召开 国企混改望大范围铺开 2、EIA: 美国原油产量下降态势料将终结 3、世行: 今年全球经济增速升至2.7% 中国放缓至6.5% 4、瑞银: 中国楼市拐点仍未到 又来一个“白银时代”				
SHIBOR		1/9/17	1/10/17	涨跌(BP)	涨跌幅度
	O/N	2.094	2.096	0.20	0.10%
	1W	2.410	2.399	-1.10	-0.46%
	2W	2.765	2.762	-0.30	-0.11%
	1M	3.474	3.531	5.76	1.66%
3M	3.515	3.553	3.74	1.06%	
CNH HIBOR		1/9/17	1/10/17	涨跌(BP)	涨跌幅度
	O/N	14.05	6.82	-723.00	-51.46%
	1W	17.81	9.90	-791.00	-44.41%
2W	15.65	10.13	-552.00	-35.27%	
银行间 同业拆借 利率		1/9/17	1/10/17	涨跌(BP)	涨跌幅度
	1D	2.147	2.158	1.13	0.53%
	7D	2.499	2.615	11.63	4.65%
	14D	2.729	2.767	3.80	1.39%
1M	4.090	3.792	-29.78	-7.28%	
银行间 质押回购 利率		1/9/17	1/10/17	涨跌(BP)	涨跌幅度
	R001	2.055	2.115	5.96	2.90%
	R007	2.372	2.382	1.01	0.43%
	R014	2.701	2.674	-2.64	-0.98%
R1M	4.151	3.875	-27.63	-6.66%	
上交所 质押回购 利率		1/9/17	1/10/17	涨跌(BP)	涨跌幅度
	GC001	1.375	2.005	63.00	45.82%
	GC003	1.620	2.155	53.50	33.02%
GC007	2.585	2.505	-8.00	-3.09%	
国债到期 收益率		1/9/17	1/10/17	涨跌(BP)	涨跌幅度
	1Y	2.7650	2.7252	-3.98	-1.44%
	3Y	2.8160	2.8191	0.31	0.11%
	5Y	2.9445	2.9119	-3.26	-1.11%
	7Y	3.1086	3.0920	-1.66	-0.53%
	10Y	3.1692	3.1792	1.00	0.32%
	20Y	3.5861	3.5864	0.03	0.01%
30Y	3.6338	3.6269	-0.69	-0.19%	
票据利率		1/4/17	1/6/17	涨跌(BP)	涨跌幅度
	转贴6M	3.00	2.85	-15.00	-5.00%
	珠三角6M	3.75	3.50	-25.00	-6.67%
	长三角6M	3.70	3.45	-25.00	-6.76%
	中西部6M	3.80	3.55	-25.00	-6.58%
	环渤海6M	3.85	3.60	-25.00	-6.49%

		收盘价	持仓量	成交量	涨跌幅度
国债期货 行情回顾	TF1703	99.550	10874	8358	-0.05%
	TF1706	98.690	5626	1670	-0.04%
	TF1709	98.200	248	14	0.07%
	T1703	97.590	36770	41400	-0.02%
	T1706	96.445	25436	12500	0.02%
	T1709	96.580	939	135	0.01%
最廉券		CTD	净价	IRR	基差
	TF1703	160007. IB	98.6509	-1.37%	0.6837
	TF1706	140013. IB	104.6224	-0.95%	2.1230
	TF1709	150026. IB	100.0967	0.56%	1.6708
	T1703	160023. IB	95.9788	-2.15%	0.8286
	T1706	160023. IB	95.9788	-1.88%	1.8967
T1709	160023. IB	95.9788	-1.37%	2.6832	
持仓建议	国海认账，市场恐慌情绪消除，但年末资金面预期仍然偏紧，叠加资本外流压力加大，货币政策边际收紧趋势难改，中期利空期债，预计期债短期仍将延续震荡行情，操作上建议观望为主。				
<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>					