



信达期货
CINDA FUTURES

国债期货早报20170112

联系人: 吕洁 F0269991 邵菁菁 F3014625

电话: 0571-28132630

邮箱: jingjing_shao@yahoo.com

要闻	1、统计局局长: 把经济运行保持在合理区间, 下限看就业上限看物价 2、特朗普重申征收高额“边境税” 美元闻讯跳涨 3、EIA原油库存增幅超预期, 但油价探底回升并刷新日高至52美元上方 4、高药价是不受惩罚的谋杀! 特朗普“重创”生物制药股				
SHIBOR		1/10/17	1/11/17	涨跌(BP)	涨跌幅度
	O/N	2.096	2.104	0.80	0.38%
	1W	2.399	2.390	-0.90	-0.38%
	2W	2.762	2.753	-0.90	-0.33%
	1M	3.531	3.566	3.48	0.99%
	3M	3.553	3.585	3.27	0.92%
CNH HIBOR		1/10/17	1/11/17	涨跌(BP)	涨跌幅度
	O/N	6.82	2.76	-406.00	-59.53%
	1W	9.90	6.66	-324.00	-32.73%
	2W	10.13	7.32	-281.00	-27.74%
银行间 同业拆借 利率		1/10/17	1/11/17	涨跌(BP)	涨跌幅度
	1D	2.158	2.165	0.68	0.32%
	7D	2.615	2.642	2.72	1.04%
	14D	2.767	2.891	12.37	4.47%
	1M	3.792	3.615	-17.68	-4.66%
银行间 质押回购 利率		1/10/17	1/11/17	涨跌(BP)	涨跌幅度
	R001	2.115	2.140	2.49	1.18%
	R007	2.382	2.425	4.30	1.81%
	R014	2.674	2.665	-0.94	-0.35%
	R1M	3.875	3.805	-7.02	-1.81%
上交所 质押回购 利率		1/10/17	1/11/17	涨跌(BP)	涨跌幅度
	GC001	2.005	2.275	27.00	13.47%
	GC003	2.155	2.400	24.50	11.37%
	GC007	2.505	2.365	-14.00	-5.59%
国债到期 收益率		1/10/17	1/11/17	涨跌(BP)	涨跌幅度
	1Y	2.7252	2.7164	-0.88	-0.32%
	3Y	2.8191	2.8530	3.39	1.20%
	5Y	2.9119	2.9531	4.12	1.41%
	7Y	3.0920	3.1308	3.88	1.25%
	10Y	3.1792	3.2055	2.63	0.83%
	20Y	3.5864	3.6112	2.48	0.69%
	30Y	3.6269	3.6488	2.19	0.60%
票据利率		1/10/17	1/11/17	涨跌(BP)	涨跌幅度
	转贴6M	2.85	2.80	-5.00	-1.75%
	珠三角6M	3.50	3.40	-10.00	-2.86%
	长三角6M	3.45	3.35	-10.00	-2.90%
	中西部6M	3.55	3.45	-10.00	-2.82%
	环渤海6M	3.60	3.50	-10.00	-2.78%

国债期货 行情回顾		收盘价	持仓量	成交量	涨跌幅度
	TF1703	99.410	10186	8233	-0.14%
	TF1706	98.565	5760	1400	-0.16%
	TF1709	98.040	248	4	-0.16%
	T1703	97.270	36735	36600	-0.33%
	T1706	96.070	26150	11200	-0.39%
	T1709	95.330	961	48	-0.29%
最廉券		CTD	净价	IRR	基差
	TF1703	160021. IB	97.5358	-1.71%	0.6906
	TF1706	120015. IB	102.1030	-0.68%	1.7145
	TF1709	120015. IB	102.1030	-0.08%	2.3277
	T1703	160023. IB	95.8174	-3.16%	0.9792
	T1706	160023. IB	95.8174	-2.42%	2.1011
	T1709	160023. IB	95.8174	-1.52%	2.7658
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。				
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。					