



信达期货
CINDA FUTURES

国债期货早报 20170912

联系人: 陈敏华

联系人: 邵菁菁

资咨询编号: Z0012670

电话: 0571-28132630

邮箱: chenminhua@cindasc.com

要闻	1、中国央行明确将外汇准备金降至零 并给出了原因 2、央行：对安理会决议所列个人和实体可暂停金融交易 3、跟进上海！广州首现“租赁住房用地” 4、新华社：联合国安理会针对朝鲜再次核试验通过制裁决议 5、央行金融研究所所长：不当将区块链和 ICO 划等号 6、一日暴增三千亿！美国债务规模正式突破 20 万亿美元				
SHIBOR		9/8/17	9/11/17	涨跌(BP)	涨跌幅度
	O/N	2.178	2.188	1.00	0.46%
	1W	2.476	2.487	1.10	0.44%
	2W	2.595	2.602	0.70	0.27%
	1M	2.740	2.743	0.34	0.12%
	3M	2.802	2.802	0.00	0.00%
CNH HIBOR		9/8/17	9/11/17	涨跌(BP)	涨跌幅度
	O/N	1.16	1.32	16.00	13.79%
	1W	1.83	2.75	92.00	50.27%
	2W	2.02	2.85	83.00	41.09%
银行间同业拆借利率		9/8/17	9/11/17	涨跌(BP)	涨跌幅度
	1D	2.254	2.261	0.66	0.29%
	7D	2.707	2.566	-14.06	-5.19%
	14D	2.835	2.769	-6.60	-2.33%
	1M	3.046	2.894	-15.15	-4.97%
银行间质押回购利率		9/8/17	9/11/17	涨跌(BP)	涨跌幅度
	R001	2.342	2.310	-3.19	-1.36%
	R007	2.639	2.758	11.96	4.53%
	R014	3.327	3.265	-6.16	-1.85%
	R1M	3.655	3.302	-35.36	-9.67%
上交所质押回购利率		9/8/17	9/11/17	涨跌(BP)	涨跌幅度
	GC001	2.625	35.410	3278.50	1248.95%
	GC003	11.845	7.290	-455.50	-38.46%
	GC007	5.000	2.885	-211.50	-42.30%
国债到期收益率		9/8/17	9/11/17	涨跌(BP)	涨跌幅度
	1Y	2.9125	2.9555	0.00	0.00%
	3Y	3.0030	3.0270	1.09	0.46%
	5Y	3.0844	3.0883	-0.57	-0.22%
	7Y	3.2173	3.2235	0.50	0.18%
	10Y	3.2730	3.3102	0.38	0.14%
	20Y	3.7428	3.7477	-0.12	-0.04%
	30Y	3.7506	3.7555	-0.63	-0.20%
票据利率		9/8/17	9/11/17	涨跌(BP)	涨跌幅度
	转贴	2.25	2.25	0.00	0.00%
	珠三角	2.40	2.40	0.00	0.00%
	长三角	2.35	2.35	0.00	0.00%
	中西部	2.45	2.45	0.00	0.00%
	环渤海	2.50	2.50	0.00	0.00%

国债期货 行情回顾		收盘价	持仓量	成交量	涨跌幅度
	TF1709	-	97	0	0.00%
	TF1712	97.625	49708	8032	-0.11%
	TF1803	97.755	695	27	-0.07%
	T1709	-	90	0	0.00%
	T1712	95.045	64841	26600	-0.13%
	0T1803	95.110	1457	90	-0.07%
最廉券		CTD	净价	IRR	基差
	TF1709	120009.IB	98.8823	4.0254%	-0.1875
	TF1712	120009.IB	98.8823	4.1621%	-0.1875
	TF1803	120009.IB	98.8823	3.9170%	-0.2413
	T1709	160017.IB	92.5608	-16.8137%	-0.7231
	T1712	160017.IB	92.5608	5.5415%	-0.6118
	T1803	160017.IB	92.5608	4.5576%	-0.7231
持仓建议	跨月后资金面紧张的局面得到一定缓解，但资金利率仍然保持在较高的位置。受上周朝鲜核试验和未来可能发射洲际导弹的担忧，市场避险情绪大幅上升。美元指数大幅上行，金价涨幅扩大。虽然避险情绪上行，但期债市场受到黑色系商品涨势和对未来农产品可能的上涨行情的担忧，仍呈现出震荡的走势。建议投资者震荡市下谨慎趋势操作，关注境外市场风险和市场流动性变化。				
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。					