



信达期货
CINDA FUTURES

国债期货早报20170113

联系人: 吕洁 F0269991 邵菁菁 F3014625

电话: 0571-28132630

邮箱: jingjing_shao@yahoo.com

要闻	1、中国12月新增信贷远超预期 但新增存款规模大幅减少 2、沙特称已超目标减产 国际油价涨逾1% 3、欧央行: 必要时可在延长期扩大QE至800亿欧元 4、美联储Harker: 经济足够强劲 加息三次合适				
SHIBOR		1/11/17	1/12/17	涨跌(BP)	涨跌幅度
	O/N	2.104	2.103	-0.10	-0.05%
	1W	2.390	2.394	0.40	0.17%
	2W	2.753	2.743	-1.00	-0.36%
	1M	3.566	3.639	7.25	2.03%
	3M	3.585	3.654	6.83	1.91%
CNH HIBOR		1/11/17	1/12/17	涨跌(BP)	涨跌幅度
	O/N	2.76	2.69	-7.00	-2.54%
	1W	6.66	5.59	-107.00	-16.07%
	2W	7.32	6.30	-102.00	-13.93%
银行间 同业拆借 利率		1/11/17	1/12/17	涨跌(BP)	涨跌幅度
	1D	2.165	2.163	-0.23	-0.11%
	7D	2.642	2.553	-8.98	-3.40%
	14D	2.891	2.736	-15.51	-5.37%
	1M	3.615	3.619	0.40	0.11%
银行间 质押回购 利率		1/11/17	1/12/17	涨跌(BP)	涨跌幅度
	R001	2.140	2.134	-0.57	-0.27%
	R007	2.425	2.380	-4.47	-1.84%
	R014	2.665	2.936	27.10	10.17%
	R1M	3.805	3.885	8.06	2.12%
上交所 质押回购 利率		1/11/17	1/12/17	涨跌(BP)	涨跌幅度
	GC001	2.275	4.320	204.50	89.89%
	GC003	2.400	2.210	-19.00	-7.92%
	GC007	2.365	2.490	12.50	5.29%
国债到期 收益率		1/11/17	1/12/17	涨跌(BP)	涨跌幅度
	1Y	2.7164	2.7147	-0.17	-0.06%
	3Y	2.8530	2.8106	-4.24	-1.49%
	5Y	2.9531	2.9616	0.85	0.29%
	7Y	3.1308	3.1105	-2.03	-0.65%
	10Y	3.2055	3.1888	-1.67	-0.52%
	20Y	3.6112	3.5989	-1.23	-0.34%
	30Y	3.6488	3.6418	-0.70	-0.19%
票据利率		1/11/17	1/12/17	涨跌(BP)	涨跌幅度
	转贴6M	2.80	2.80	0.00	0.00%
	珠三角6M	3.40	3.40	0.00	0.00%
	长三角6M	3.35	3.35	0.00	0.00%
	中西部6M	3.45	3.45	0.00	0.00%
	环渤海6M	3.50	3.50	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
	TF1703	99.460	9724	7421	0.05%
	TF1706	98.630	6192	1043	0.05%
	TF1709	98.200	249	3	0.16%
	T1703	97.355	35974	36600	0.06%
	T1706	96.150	26907	9246	0.04%
	T1709	95.385	954	74	0.07%
最廉券		CTD	净价	IRR	基差
	TF1703	160007. IB	98.5158	-1.23%	0.6372
	TF1706	160021. IB	97.5370	-0.80%	1.3234
	TF1709	160021. IB	97.5370	-0.02%	1.6054
	T1703	160023. IB	95.9000	-3.50%	1.0197
	T1706	160017. IB	96.3161	-2.52%	2.1564
	T1709	160017. IB	96.3161	-1.63%	2.8579
持仓建议	资金面保持宽松，但春节前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。					