



信达期货
CINDA FUTURES

国债期货早报20170116

联系人: 吕洁 F0269991 邵菁菁 F3014625

电话: 0571-28132630

邮箱: jingjing_shao@yahoo.com

要闻	1、梅姨下决心“硬脱欧” 英镑暴跌开盘 2、2016年各省市GDP成绩单陆续出炉, 重庆增速超10%再次领跑 3、意大利全面失去A评级 欧洲银行业问题或倒逼欧央行缩减QE 4、郭磊: 12月出口数据并不差 趋势好转特征明显				
SHIBOR		1/12/17	1/13/17	涨跌(BP)	涨跌幅度
	O/N	2.103	2.104	0.10	0.05%
	1W	2.394	2.398	0.40	0.17%
	2W	2.743	2.763	1.96	0.71%
	1M	3.639	3.672	3.31	0.91%
	3M	3.654	3.687	3.38	0.93%
CNH HIBOR		1/12/17	1/13/17	涨跌(BP)	涨跌幅度
	O/N	2.69	7.57	488.00	181.41%
	1W	5.59	10.19	460.00	82.29%
	2W	6.30	9.06	276.00	43.81%
银行间 同业拆借 利率		1/12/17	1/13/17	涨跌(BP)	涨跌幅度
	1D	2.163	2.158	-0.46	-0.21%
	7D	2.553	2.540	-1.23	-0.48%
	14D	2.736	3.093	35.76	13.07%
	1M	3.619	3.651	3.19	0.88%
银行间 质押回购 利率		1/12/17	1/13/17	涨跌(BP)	涨跌幅度
	R001	2.134	2.110	-2.47	-1.16%
	R007	2.380	2.385	0.54	0.23%
	R014	2.936	2.648	-28.74	-9.79%
	R1M	3.885	3.929	4.36	1.12%
上交所 质押回购 利率		1/12/17	1/13/17	涨跌(BP)	涨跌幅度
	GC001	4.320	2.605	-171.50	-39.70%
	GC003	2.210	0.555	-165.50	-74.89%
	GC007	2.490	2.705	21.50	8.63%
国债到期 收益率		1/12/17	1/13/17	涨跌(BP)	涨跌幅度
	1Y	2.7147	2.6866	-2.81	-1.04%
	3Y	2.8106	2.8121	0.15	0.05%
	5Y	2.9616	2.9452	-1.64	-0.55%
	7Y	3.1105	3.1067	-0.38	-0.12%
	10Y	3.1888	3.2022	1.34	0.42%
	20Y	3.5989	3.6113	1.24	0.34%
	30Y	3.6418	3.6414	-0.04	-0.01%
票据利率		1/12/17	1/13/17	涨跌(BP)	涨跌幅度
	转贴6M	2.80	2.80	0.00	0.00%
	珠三角6M	3.40	3.35	-5.00	-1.47%
	长三角6M	3.35	3.30	-5.00	-1.49%
	中西部6M	3.45	3.40	-5.00	-1.45%
	环渤海6M	3.50	3.45	-5.00	-1.43%

国债期货 行情回顾		收盘价	持仓量	成交量	涨跌幅度
	TF1703	99.580	9078	7266	-0.03%
	TF1706	98.735	6453	1270	0.00%
	TF1709	98.170	247	5	-0.03%
	T1703	97.495	34882	29000	-0.05%
	T1706	96.230	27007	10400	-0.08%
	T1709	95.425	964	87	-0.14%
最廉券		CTD	净价	IRR	基差
	TF1703	160007. IB	98.5469	-0.76%	0.5502
	TF1706	160021. IB	97.5840	-0.69%	1.2680
	TF1709	160021. IB	97.5840	-0.15%	1.6817
	T1703	160023. IB	95.8621	-2.25%	0.8045
	T1706	160023. IB	95.8621	-2.21%	1.9897
	T1709	160023. IB	95.8621	-1.47%	2.7178
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。					