



信达期货
CINDA FUTURES

国债期货早报20170117

联系人: 吕洁 F0269991 邵菁菁 F3014625
电话: 0571-28132630
邮箱: jingjing_shao@yahoo.com

要闻	1、A股尾盘“V形”反弹 创业板一度暴跌6% 2、美联储通讯社: 超宽松货币刺激时代将结束 3、媒体: 今年监管层或将再融资规模控制在去年一半 4、媒体披露梅姨退欧讲话: 不会有任何‘半退半留’的方案				
SHIBOR		1/13/17	1/14/17	涨跌(BP)	涨跌幅度
	O/N	2.104	2.142	3.80	1.81%
	1W	2.398	2.424	2.59	1.08%
	2W	2.763	2.782	1.89	0.68%
	1M	3.672	3.685	1.34	0.36%
3M	3.687	3.702	1.44	0.39%	
CNH HIBOR		1/13/17	1/14/17	涨跌(BP)	涨跌幅度
	O/N	7.57	2.86	-471.00	-62.22%
	1W	10.19	9.25	-94.00	-9.22%
2W	9.06	9.35	29.00	3.20%	
银行间 同业拆借 利率		1/13/17	1/14/17	涨跌(BP)	涨跌幅度
	1D	2.158	2.197	3.83	1.77%
	7D	2.540	2.620	8.01	3.15%
	14D	3.093	2.883	-21.03	-6.80%
1M	3.651	3.871	22.06	6.04%	
银行间 质押回购 利率		1/13/17	1/14/17	涨跌(BP)	涨跌幅度
	R001	2.110	2.201	9.12	4.32%
	R007	2.385	2.584	19.89	8.34%
	R014	2.648	3.071	42.28	15.96%
R1M	3.929	4.158	22.89	5.83%	
上交所 质押回购 利率		1/13/17	1/14/17	涨跌(BP)	涨跌幅度
	GC001	2.605	2.585	-2.00	-0.77%
	GC003	0.555	2.625	207.00	372.97%
GC007	2.705	3.365	66.00	24.40%	
国债到期 收益率		1/13/17	1/14/17	涨跌(BP)	涨跌幅度
	1Y	2.6866	2.6224	-6.42	-2.39%
	3Y	2.8121	2.7933	-1.88	-0.67%
	5Y	2.9452	2.9596	1.44	0.49%
	7Y	3.1067	3.1226	1.59	0.51%
	10Y	3.2022	3.2496	4.74	1.48%
	20Y	3.6113	3.6213	1.00	0.28%
30Y	3.6414	3.6514	1.00	0.27%	
票据利率		1/13/17	1/14/17	涨跌(BP)	涨跌幅度
	转贴6M	2.80	2.80	0.00	0.00%
	珠三角6M	3.35	3.35	0.00	0.00%
	长三角6M	3.30	3.30	0.00	0.00%
	中西部6M	3.40	3.40	0.00	0.00%
环渤海6M	3.45	3.45	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	99.140	9401	8875	-0.48%
	TF1706	98.305	7046	1777	-0.44%
	TF1709	97.825	250	11	-0.39%
	T1703	96.860	34807	45700	-0.68%
	T1706	95.460	30308	23000	-0.80%
	T1709	94.700	998	266	-0.76%
最廉券		CTD	净价	IRR	基差
	TF1703	160021. IB	97.4559	-3.27%	0.8737
	TF1706	160021. IB	97.4559	-1.49%	1.5594
	TF1709	160021. IB	97.4559	-0.51%	1.8907
	T1703	150005. IB	103.6708	2.17%	0.2232
	T1706	150005. IB	103.6708	-0.80%	1.8016
	T1709	150005. IB	103.6708	-0.51%	2.7178
持仓建议	昨日资金面紧张导致期债大跌，节前资金面预期依然偏紧，叠加资本外流压力，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偏弱震荡行情，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。					