

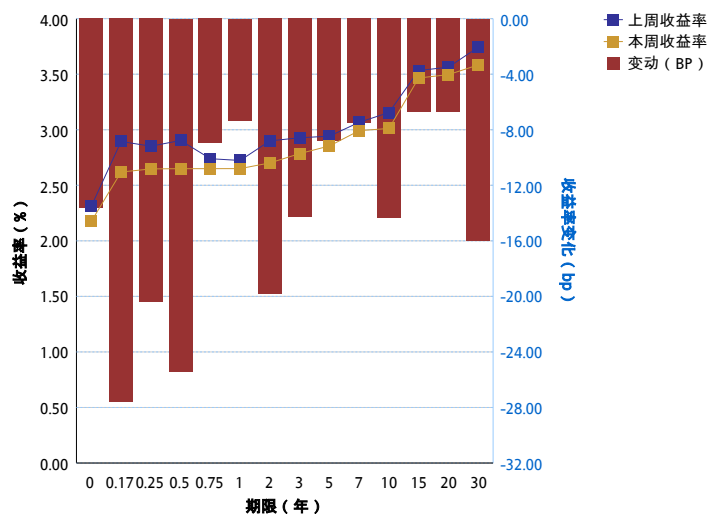
指数20161226--20161231

指数名称	指标名称	20161231	20161226	变化率(%)	上涨点数
中债-综合指数	净价指数	102.2181	101.8002	0.41	0.4179
中债-综合指数	平均市值法久期	3.9809	3.9470	0.86	0.0339
中债-综合指数	财富指数	177.3164	176.4991	0.46	0.8173

收益率曲线变动情况20161226-20161231

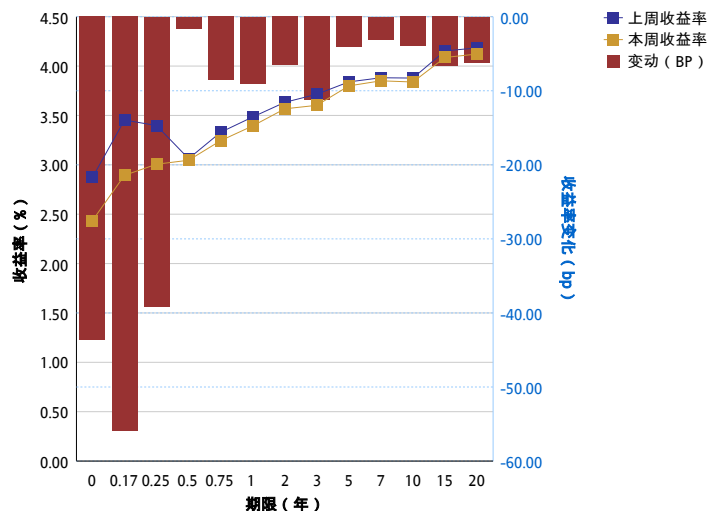
1.中债国债收益率曲线关键期限比较

期限 (年)	20161226	20161231	变动 (bp)
0.00	2.3115	2.1752	-13.63
0.17	2.8948	2.6190	-27.58
0.25	2.8517	2.6474	-20.43
0.50	2.9036	2.6494	-25.41
0.75	2.7391	2.6497	-8.94
1.00	2.7236	2.6503	-7.33
2.00	2.8999	2.7014	-19.85
3.00	2.9278	2.7850	-14.28
5.00	2.9422	2.8540	-8.81
7.00	3.0670	2.9918	-7.52
10.00	3.1551	3.0115	-14.35
15.00	3.5331	3.4659	-6.72
20.00	3.5633	3.4961	-6.72
30.00	3.7428	3.5831	-15.97
平均	3.0182	2.8771	-14.11



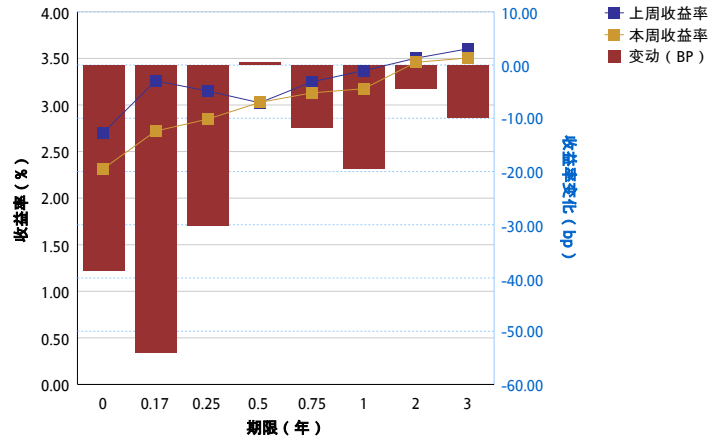
2.政策性银行债收益率曲线关键期限点比较

期限 (年)	20161226	20161231	变动 (bp)
0.00	2.8720	2.4357	-43.63
0.17	3.4534	2.8938	-55.96
0.25	3.3975	3.0062	-39.13
0.50	3.0626	3.0466	-1.60
0.75	3.3300	3.2448	-8.52
1.00	3.4845	3.3942	-9.03
2.00	3.6327	3.5672	-6.55
3.00	3.7148	3.6026	-11.21
5.00	3.8399	3.7994	-4.05
7.00	3.8816	3.8508	-3.08
10.00	3.8786	3.8387	-3.99
15.00	4.1539	4.0873	-6.66
20.00	4.1836	4.1217	-6.19
平均	3.6065	3.4530	-15.35



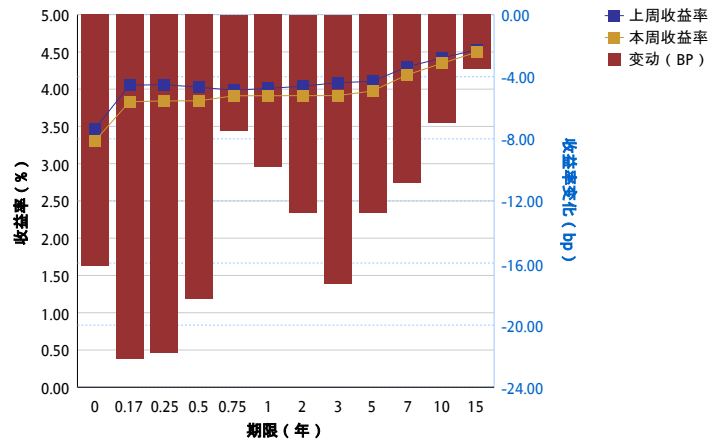
3.央票收益率曲线关键期限点比较

期限 (年)	20161226	20161231	变动 (bp)
0.00	2.7040	2.3177	-38.63
0.17	3.2595	2.7197	-53.98
0.25	3.1500	2.8480	-30.20
0.50	3.0237	3.0277	0.40
0.75	3.2482	3.1299	-11.83
1.00	3.3692	3.1745	-19.47
2.00	3.5027	3.4584	-4.43
3.00	3.6032	3.5053	-9.79
平均	3.2326	3.0226	-20.99



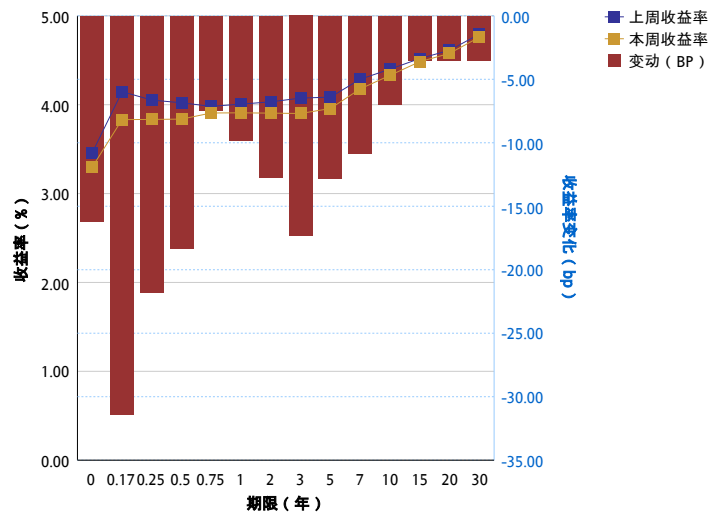
4.AAA中短期票据收益率曲线关键期限点比较

期限 (年)	20161226	20161231	变动 (bp)
0.00	3.4653	3.3034	-16.19
0.17	4.0533	3.8316	-22.17
0.25	4.0600	3.8421	-21.79
0.50	4.0262	3.8430	-18.32
0.75	3.9860	3.9113	-7.47
1.00	4.0097	3.9116	-9.81
2.00	4.0403	3.9129	-12.74
3.00	4.0868	3.9135	-17.32
5.00	4.1044	3.9765	-12.79
7.00	4.3010	4.1925	-10.86
10.00	4.4170	4.3472	-6.99
15.00	4.5314	4.4963	-3.51
平均	4.0901	3.9568	-13.33



5.AAA企业债收益率曲线关键期限点比较

期限 (年)	20161226	20161231	变动 (bp)
0.00	3.4615	3.2996	-16.19
0.17	4.1463	3.8324	-31.39
0.25	4.0520	3.8341	-21.79
0.50	4.0213	3.8381	-18.32
0.75	3.9813	3.9066	-7.47
1.00	4.0065	3.9084	-9.81
2.00	4.0322	3.9048	-12.74
3.00	4.0744	3.9011	-17.33
5.00	4.0850	3.9571	-12.79
7.00	4.2862	4.1777	-10.86
10.00	4.3995	4.3297	-6.98
15.00	4.5188	4.4837	-3.52
20.00	4.6121	4.5770	-3.50
30.00	4.7932	4.7581	-3.51
平均	4.1764	4.0506	-12.59



市场交易概览20161226--20161231

序号	业务类别	本周结算面额 (亿元)	结算面额较上周涨跌幅 (%)	本周笔数	笔数较上周涨跌幅 (%)
1	现券交易	8,137.05	1.66	8,762	-5.94
2	质押式回购	56,598.60	30.49	12,622	16.99
3	买断式回购	1,939.06	-20.13	1,226	-35.85
4	远期交割	-	-	-	-
5	债券借贷	215.80	82.54	85	57.41
汇总		66,890.51	23.64	22,695	8.15

现券交易情况20161226--20161231

债券类别	本周结算面额 (亿元)	结算面额较上周涨跌幅 (%)	本周笔数	笔数较上周涨跌幅 (%)
中央企业债	81.20	50.54	42	-2.33
中期票据	180.95	-25.83	274	-9.57
二级资本工具	98.10	120.40	95	171.43
保险公司金融债	4.00	-79.38	2	-66.67
商业银行债券	88.67	-53.36	69	-26.60
地方企业债	681.14	-10.82	1,516	-10.24
地方政府债	312.28	5.32	136	3.82
扶贫专项金融债	5.30	430.00	8	33.33
政府支持机构债	79.34	-43.99	78	-25.71
政策性银行债券	4,598.82	-10.33	5,037	-11.66
记账式国债	1,919.03	88.18	1,413	28.45
资产支持证券	43.53	-6.58	28	-24.32
集合企业债	2.30	-34.29	6	200.00
非银行金融机构债	11.50	-69.58	11	-68.57
项目收益债券	30.90	130.60	47	74.07
合计	8,137.05	32.73	8,762	17.70

质押式回购交易情况20161226--20161231

交易期限品种	正回购面额 (亿元)	正回购笔数	利率 (最小)	利率 (最大)	利率 (平均)
R01D	32,199.56	6,323	0.0170	0.0350	0.0215
R01M	95.46	30	0.0300	0.0660	0.0528
R01Y	13.60	4	0.0336	0.0460	0.0373
R02D	607.28	138	0.0190	0.0500	0.0267
R02M	314.52	151	0.0300	0.0700	0.0530
R03D	2,562.26	316	0.0140	0.0344	0.0227
R03M	92.53	52	0.0400	0.0700	0.0524
R04M	2.00	1	0.0470	0.0470	0.0470
R06M	32.80	9	0.0450	0.0485	0.0474
R07D	17,299.68	4,149	0.0200	0.0950	0.0360
R14D	2,967.47	1,233	0.0225	0.0880	0.0516
R21D	411.44	216	0.0300	0.0800	0.0581
合计	56,598.60	12,622	0.0140	0.0950	0.0422