

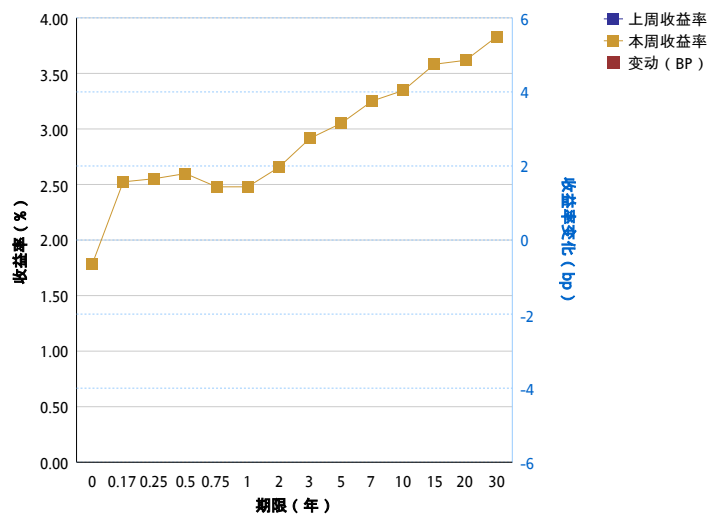
指数20181209--20181214

指数名称	指标名称	20181214	20181209	变化率(%)	上涨点数
中债-国债总指数	财富指数	181.5286			
中债-国债总指数	净价指数	117.5941			
中债-国债总指数	平均市值法久期	6.4533			
中债-金融债券总指数	财富指数	185.3410			
中债-金融债券总指数	净价指数	116.4892			
中债-金融债券总指数	平均市值法久期	4.3252			
中债-企业债总指数	财富指数	177.9817			
中债-企业债总指数	净价指数	79.4088			
中债-企业债总指数	平均市值法久期	2.3567			
中债-新综合指数	财富指数				
中债-新综合指数	净价指数	99.6694			
中债-新综合指数	平均市值法久期	3.6584			

收益率曲线变动情况20181209-20181214

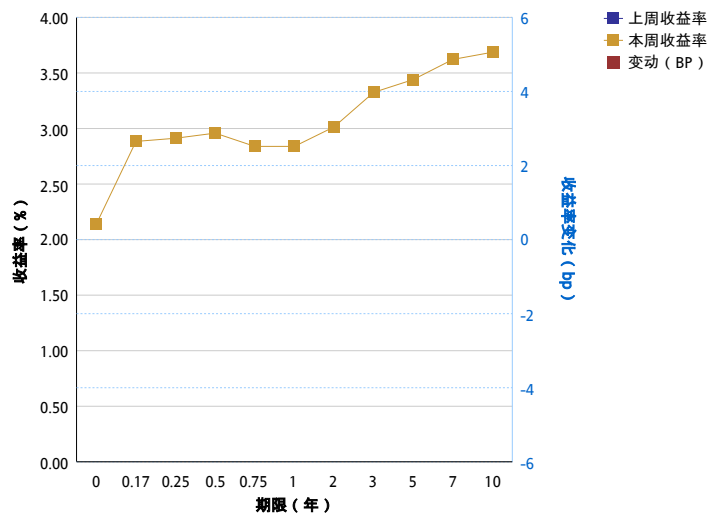
1.中债国债收益率曲线

期限 (年)	2018-12-09 (%)	2018-12-14 (%)	变动 (bp)
0.00	-	1.7800	-
0.17	-	2.5238	-
0.25	-	2.5525	-
0.50	-	2.5985	-
0.75	-	2.4791	-
1.00	-	2.4792	-
2.00	-	2.6545	-
3.00	-	2.9153	-
5.00	-	3.0506	-
7.00	-	3.2520	-
10.00	-	3.3468	-
15.00	-	3.5826	-
20.00	-	3.6181	-
30.00	-	3.8307	-



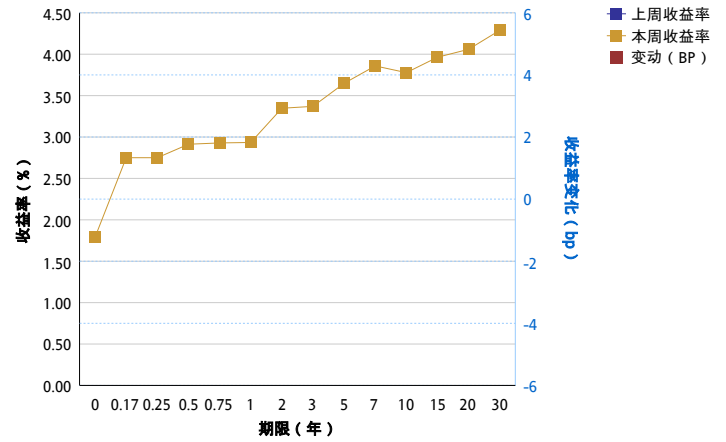
2.中债地方政府债收益率曲线(AAA)

期限 (年)	2018-12-09 (%)	2018-12-14 (%)	变动 (bp)
0.00	-	2.1400	-
0.17	-	2.8838	-
0.25	-	2.9125	-
0.50	-	2.9585	-
0.75	-	2.8391	-
1.00	-	2.8392	-
2.00	-	3.0145	-
3.00	-	3.3253	-
5.00	-	3.4406	-
7.00	-	3.6220	-
10.00	-	3.6868	-



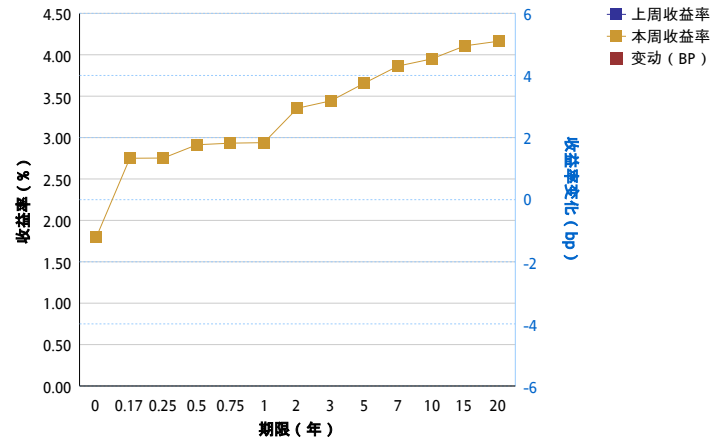
3.中债国开债收益率曲线

期限 (年)	2018-12-09 (%)	2018-12-14 (%)	变动 (bp)
0.00	-	1.7917	-
0.17	-	2.7500	-
0.25	-	2.7500	-
0.50	-	2.9128	-
0.75	-	2.9285	-
1.00	-	2.9342	-
2.00	-	3.3474	-
3.00	-	3.3703	-
5.00	-	3.6485	-
7.00	-	3.8585	-
10.00	-	3.7774	-
15.00	-	3.9632	-
20.00	-	4.0595	-
30.00	-	4.2885	-



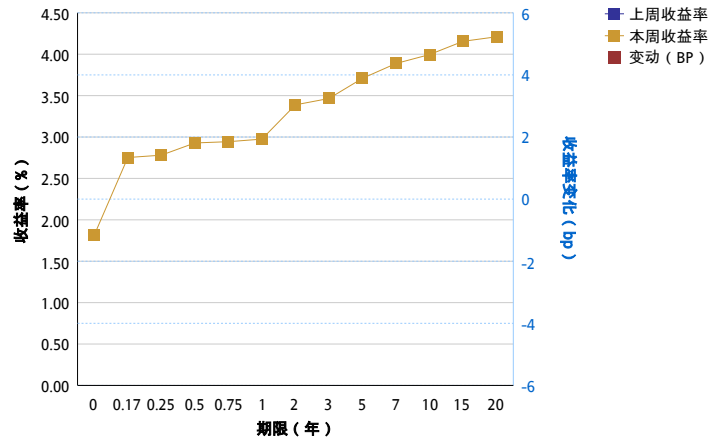
4.中债农发行债收益率曲线

期限 (年)	2018-12-09 (%)	2018-12-14 (%)	变动 (bp)
0.00	-	1.7962	-
0.17	-	2.7500	-
0.25	-	2.7528	-
0.50	-	2.9131	-
0.75	-	2.9326	-
1.00	-	2.9387	-
2.00	-	3.3542	-
3.00	-	3.4442	-
5.00	-	3.6578	-
7.00	-	3.8634	-
10.00	-	3.9493	-
15.00	-	4.1082	-
20.00	-	4.1637	-



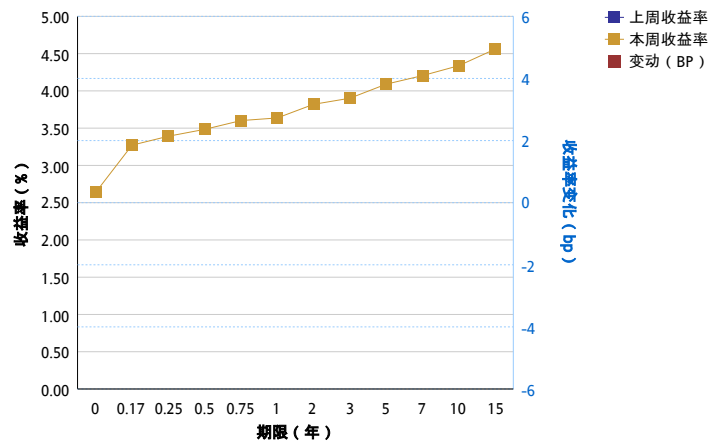
5.中债进出口行债收益率曲线

期限 (年)	2018-12-09 (%)	2018-12-14 (%)	变动 (bp)
0.00	-	1.8163	-
0.17	-	2.7524	-
0.25	-	2.7807	-
0.50	-	2.9284	-
0.75	-	2.9434	-
1.00	-	2.9747	-
2.00	-	3.3886	-
3.00	-	3.4653	-
5.00	-	3.7088	-
7.00	-	3.8879	-
10.00	-	3.9956	-
15.00	-	4.1556	-
20.00	-	4.2104	-



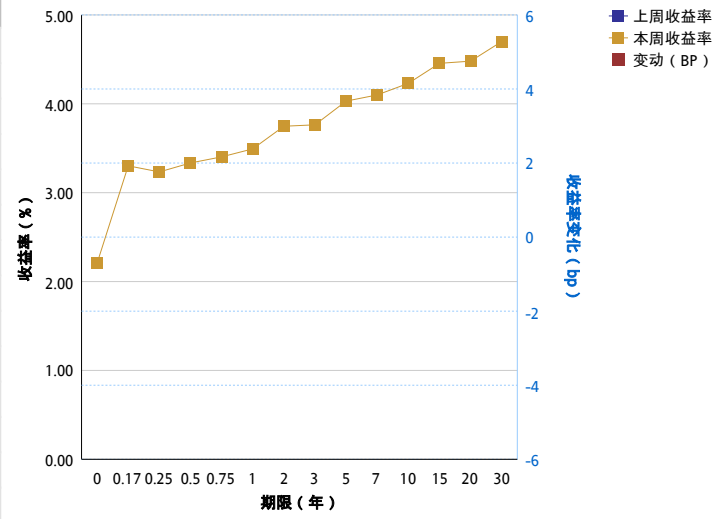
6.AAA中短期票据收益率曲线

期限 (年)	2018-12-09 (%)	2018-12-14 (%)	变动 (bp)
0.00	-	2.6385	-
0.17	-	3.2717	-
0.25	-	3.3916	-
0.50	-	3.4839	-
0.75	-	3.6016	-
1.00	-	3.6370	-
2.00	-	3.8198	-
3.00	-	3.9017	-
5.00	-	4.0904	-
7.00	-	4.2050	-
10.00	-	4.3384	-
15.00	-	4.5605	-



7.中债商业银行普通债收益率曲线(AAA)

期限 (年)	2018-12-09 (%)	2018-12-14 (%)	变动 (bp)
0.00	-	2.2067	-
0.17	-	3.3021	-
0.25	-	3.2334	-
0.50	-	3.3345	-
0.75	-	3.4028	-
1.00	-	3.4928	-
2.00	-	3.7475	-
3.00	-	3.7635	-
5.00	-	4.0302	-
7.00	-	4.0998	-
10.00	-	4.2305	-
15.00	-	4.4554	-
20.00	-	4.4799	-
30.00	-	4.7009	-



市场交易概览20181209--20181214

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	27,476.64	55.73	29,122	52.86
2	质押式回购	131,464.03	77.23	30,538	73.73
3	买断式回购	1,973.05	72.47	1,040	73.62
4	远期交割	-	-	-	-
5	债券借贷	615.54	172.86	298	92.26
汇总		161,529.26	94.57	60,998	73.12

现券交易情况20181209--20181214

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	22.93	23.28	32	68.42
中期票据	15.21	-44.27	25	-32.43
二级资本工具	344.80	120.32	201	142.17
保险公司金融债	24.56	1,272.07	24	200.00
商业银行债券	434.54	3.24	343	7.19
地方企业债	446.60	57.10	1,017	61.43
地方政府债	1,856.67	20.98	953	36.73
扶贫专项金融债	200.70	1.57	127	4.10
政府支持机构债	335.80	-3.48	133	12.71
政策性银行债券	18,281.92	60.52	22,682	53.50
记账式国债	5,295.47	65.05	3,386	55.39
资产支持证券	78.77	162.23	58	176.19
集合企业债	0.20	-	1	-
非银行金融机构债	125.42	489.66	114	245.45
项目收益债券	13.04	153.70	26	225.00
合计	27,476.64	170.14	29,122	89.70

质押式回购交易情况20181209--20181214

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	92,424.55	18,975	0.0150	0.0320	0.0250
R01M	1,710.67	779	0.0265	0.0650	0.0401
R02D	359.94	148	0.0210	0.0300	0.0253
R02M	467.55	189	0.0320	0.0650	0.0403
R03D	22,179.40	5,276	0.0170	0.0500	0.0272
R03M	43.36	48	0.0320	0.0650	0.0380
R04M	51.37	13	0.0325	0.0526	0.0365
R06M	24.29	11	0.0335	0.0390	0.0358
R07D	10,164.06	4,000	0.0180	0.0355	0.0270
R09M	5.00	2	0.0360	0.0360	0.0360
R14D	2,239.86	735	0.0220	0.0400	0.0269
R21D	1,793.99	362	0.0208	0.0650	0.0349
合计	131,464.03	30,538	0.0150	0.0650	0.0328