



国债

20170112

信达达货
CINDA PRODUCTS

人: 吕 F0269991 F3014625
: 0571-28132630
: jingjing_shao@yahoo.com

	1、局局 : 保 在合 区 , 下 就业上 价				
	2、 “ 境 ” 元				
	3、EIA原 存增幅 , 但 价 回升 刷 52 元上				
	4、 价 不受 ! “ 创 ” 制				
SHIBOR		1/10/17	1/11/17	(BP)	幅
	O/N	2.096	2.104	0.80	0.38%
	1W	2.399	2.390	-0.90	-0.38%
	2W	2.762	2.753	-0.90	-0.33%
	1M	3.531	3.566	3.48	0.99%
	3M	3.553	3.585	3.27	0.92%
CNH HIBOR		1/10/17	1/11/17	(BP)	幅
	O/N	6.82	2.76	-406.00	-59.53%
	1W	9.90	6.66	-324.00	-32.73%
	2W	10.13	7.32	-281.00	-27.74%
同业 借 利		1/10/17	1/11/17	(BP)	幅
	1D	2.158	2.165	0.68	0.32%
	7D	2.615	2.642	2.72	1.04%
	14D	2.767	2.891	12.37	4.47%
	1M	3.792	3.615	-17.68	-4.66%
回 利		1/10/17	1/11/17	(BP)	幅
	R001	2.115	2.140	2.49	1.18%
	R007	2.382	2.425	4.30	1.81%
	R014	2.674	2.665	-0.94	-0.35%
	R1M	3.875	3.805	-7.02	-1.81%
上交 回 利		1/10/17	1/11/17	(BP)	幅
	GC001	2.005	2.275	27.00	13.47%
	GC003	2.155	2.400	24.50	11.37%
	GC007	2.505	2.365	-14.00	-5.59%
国债到		1/10/17	1/11/17	(BP)	幅
	1Y	2.7252	2.7164	-0.88	-0.32%
	3Y	2.8191	2.8530	3.39	1.20%
	5Y	2.9119	2.9531	4.12	1.41%
	7Y	3.0920	3.1308	3.88	1.25%
	10Y	3.1792	3.2055	2.63	0.83%
	20Y	3.5864	3.6112	2.48	0.69%
	30Y	3.6269	3.6488	2.19	0.60%
利		1/10/17	1/11/17	(BP)	幅
	帖6M	2.85	2.80	-5.00	-1.75%
	三 6M	3.50	3.40	-10.00	-2.86%
	三 6M	3.45	3.35	-10.00	-2.90%
	中 6M	3.55	3.45	-10.00	-2.82%
	6M	3.60	3.50	-10.00	-2.78%

		价	仓	交	幅
国债 回	TF1703	99.410	10186	8233	-0.14%
	TF1706	98.565	5760	1400	-0.16%
	TF1709	98.040	248	4	-0.16%
	T1703	97.270	36735	36600	-0.33%
	T1706	96.070	26150	11200	-0.39%
	T1709	95.330	961	48	-0.29%
券		CTD	净价	IRR	基差
	TF1703	160021. IB	97.5358	-1.71%	0.6906
	TF1706	120015. IB	102.1030	-0.68%	1.7145
	TF1709	120015. IB	102.1030	-0.08%	2.3277
	T1703	160023. IB	95.8174	-3.16%	0.9792
	T1706	160023. IB	95.8174	-2.42%	2.1011
T1709	160023. IB	95.8174	-1.52%	2.7658	
仓	<p>国，市场，但年仍偏，叠加外压力 加大，币势，中利债，债仍将 ，作上为主。</p>				
<p>告中 信 均 于公 可 ，信 公司力 准 可 ，但对 些信 准 及完 不做任何保 ， ，任 。 信 公司 可，任何 、 以及向 三 传 告 为均可 任。</p>					