

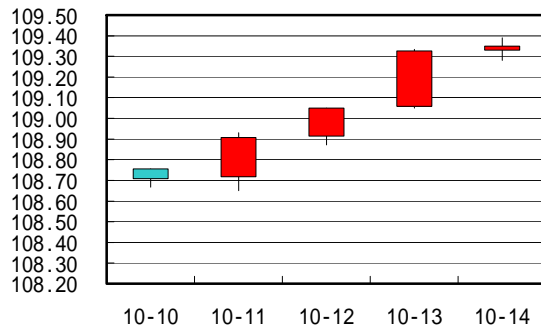
本周债券指数表现

指数	开盘	收盘	涨跌幅 (%)	成交额 (亿元)
上证国债	108.76	109.35	0.60	69.97
上证企债	116.61	117.52	0.78	4.93
深证企债	117.28	118.24	0.83	4.54

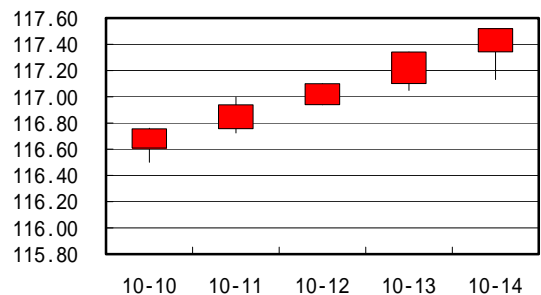
本周主要市场指数表现

指数	开盘	收盘	涨跌幅 (%)	成交额 (亿元)
上证指数	1153.67	1139.55	-1.39	375.37
上证 180 指数	2172.26	2137.53	-1.67	168.55
上证 50 指数	792.76	777.49	-2.04	84.28
上证基金	790.59	773.49	-2.17	12.51
沪深 300 指数	917.21	904.83	-1.37	259.41
深圳成指	2902.21	2830.76	-2.49	52.08
深证基金	706.86	695.07	-1.65	1.81

上证国债指数走势



上证企债指数走势



市场表现

- 沪市国债 29 涨 1 平 8 跌,成交额较上周增加 26.31 亿元。涨幅靠前个券有: 21 国债(7), 为 1.57%, 其次是 03 国债(3)、05 国债(4), 分别为 1.45%、1.39%; 跌幅靠前个券有: 96 国债(6), 为 -.89%, 其次是 05 国债(6)、99 国债(5), 分别为 -.14%、-.13%。
- 两市企债 41 涨 2 平 5 跌,成交额较上周增加 2.33 亿元。涨幅靠前个券有: 04 京地铁, 为 3.36%, 其次是 04 中石化、02 中移(15), 分别为 1.57%、1.46%; 跌幅靠前个券有: 98 中铁(3), 为 -2.69%, 其次是 03 华能 1、98 中信(7), 分别为 -.29%、-.21%。
- 两市可转债 4 涨 7 平 19 跌,成交额较上周萎缩 2.05 亿元。涨幅靠前个券有: 歌华转债, 为 1.46%, 其次是华菱转债、桂冠转债, 分别为 .35%、.29%; 跌幅靠前个券有: 雅戈转债, 为 -3.96%, 其次是燕京转债、复星转债, 分别为 -3.38%、-2.56%。
- 交易所回购市场 5 涨 21 平 7 跌,成交额较上周增加 69.13 亿元。涨幅靠前品种有 R007, 为 155.14%, 其次是 R014、RC007, 分别为 114.29%、114.29%; 跌幅靠前品种有: R004, 为 -64.09%, 其次是 R002、RC003, 分别为 -56.94%、-52.33%。

一周宏观信息

● 证券法、公司法修订案月底提交人大表决

北京消息 继8月下旬提交十届人大常委会第十七次会议二审后,证券法修订草案、公司法修订草案有望于本月底提交人大常委会第十八次会议三审,并交付表决。

权威人士透露,证券法三审稿与二审稿相比没有实质性变化,证监会获得的查封三类“问题账户”的“准司法权”将得到保留。

● 信贷资产证券化试点法规获原则通过

《金融机构信贷资产证券化试点监督管理办法》日前在银监会第38次主席会议上获得原则通过。会议指出,资产证券化业务涉及发起机构、特定目的机构、受托机构、服务机构、评级机构、信用增级提供机构、投资者等众多交易主体,且同一主体往往兼任多个角色,交易结构复杂,风险隐蔽性强,这既要求参与机构能有效识别和控制相关风险,也需要银行业监管机构加强审慎监管。会议强调,监管办法不仅要能满足现阶段资产证券化试点的要求,而且还要基本适应未来业务的发展需要。业内人士分析认为,这意味着信贷资产证券化试点工作又跨过一道坎,不过其正式推出可能仍需时日。

● 首批国际发行人获准发行21.3亿人民币债券

近日,央行批准国际金融公司(IFC)和亚洲开发银行(ADB)在全国银行间债券市场分别发行人民币债券11.3亿元和10亿元。

央行相关负责人表示,这是中国债券市场首次引入外资机构发行主体,是中国债券市场对外开放的重要举措和有益尝试。此次国际金融公司和亚洲开发银行获准在我国境内发行人民币债券,是发行主体的突破和创新,有利于促进我国债券市场的进一步发展,在一定程度上改善我国目前直接融资比重过小、融资结构不合理的状况;有利于促进我国债券市场的对外开放。此外,允许国际开发机构在国内发行人民币债券,并用所筹资金投资于国内企业,有利于降低国内贷款企业汇率风险。

● 央行表态应允许场外交易市场存在

央行副行长吴晓灵13日在“中国经济50人论坛——中国经济政策研讨会”上表示,今后银行信贷不能过多增加,应大力发展直接融资,发展多层次的资本市场,在统一会计准则、统一制度和严格信息披露的前提下,允许场外交易和柜台交易市场的存在。

吴晓灵认为,解决中小企业融资难可采取三大措施解决:大银行成立专门中小企业部;多发展当地法人的小金融机构;鼓励发展只贷款不存款的金融机构,让富余资金投向中小企业。目前央行已经拟定了发展只发放贷款不吸收存款金融机构的制度草稿,正和银监会协商,将会比较快地推出。

她还表示,在以后的金融管理上,对存款类金融机构重在内部风险控制,减少新业务审批;培育集合理财机构,加强合同管理和风险提示;发育非存款类金融机构,拓宽金融投资渠道,把民间资本纳入正规的融资渠道;发展金融衍生产品,重在建立风险控制和强制止损制度;严格控制吸收公众存款,规范个人、企业相互信贷。

● 社科院报告预计2005年我国GDP增长9.4%

社科院《中国经济形势分析与预测》课题组13日公布的2005年秋季报告预测,2005年我国国民经济增长速度将与上年基本持平,GDP增长率将达到9.4%左右。2006年的GDP增长在没有其他因素的影响下,将保持在8.9%的水平上。

与此同时,报告预测,随着居民消费能力的上升和供给结构的调整,消费价格指数不会出现崩溃式的滑落。此外,由于目前上游产品价格、生产资料价格依然处于相对较高的水平,从总体上看,经济运行出现通货紧缩的可能性不大。

在价格指数方面,报告认为,2005年宏观调控措施在减缓价格水平上涨压力方面产生了明显效果,各项价格指数,特别是居民消费价格指数和社会商品零售价格指数上涨率都从2004年的水平逐渐下降,保持在相对较低的水平上。在目前情况下,不会出现通货紧缩。预计2005年和2006年社会商品零售价格指数的年变动率将分别为0.9%和1.2%,消费价格指数变动率将分别为1.9%和2.1%。需要关注的是上游产品的价格上涨率仍然相对较高。

债券市场信息

● 央行一周回笼千亿, 6 月票据再现市场

13 日, 央行在公开市场发行了 600 亿元央行票据, 至此本周央行共计回笼资金量达到 1000 亿元整数关 (900 亿票据、100 亿回购), 净回笼资金量为 510 亿元, 创下半年票据单周最高发行纪录。债市交易员表示, 这意味着央行对资金有收紧的倾向, 但是暂不会影响目前债市宽裕的资金面。当日, 央行暂停了持续数月 182 天正回购的操作, 取而代之的是资金锁定能力相同的 6 个月央行票据。业内人士分析认为, 6 个月央行票据重启一方面可以增加债券的供给量, 另一方面表明央行手中用于进行正回购的债券数额可能为数不多。当日, 发行的 600 亿央票中, 6 个月央票 200 亿元, 发行收益率 1.2309%, 比前次 182 天正回购低约一个基点。3 个月央票 400 亿元, 发行收益率与前次发行持平, 仍为 1.1666%。

● 2005 年广东省交通集团有限公司公司债券将上市

2005 年广东省交通集团有限公司公司债券 (证券代码: 111026, 证券简称: 05 粤交通) 将于 2005 年 10 月 18 日在深交所上市。该债券发行总额 15 亿元, 为固定利率付息债, 债券期限 15 年, 票面年利率 5.3%, 每年 06 月 29 日付息, 债券信用级别为 AAA 级。

● 招行成功发行百亿金融债

13 日, 招商银行在银行间市场成功发行第一期金融债券, 发行量为 100 亿元。本次发行所募集资金将用于调整和优化招商银行资产负债结构。本期债券分两个品种, 期限为 3 年的发行利率 2.13%; 期限为 5 年的发行利率 2.56%。两期债券的发行量均为 50 亿元。债券的本金和利息的清偿顺序等同于商业银行一般负债, 先于商业银行长期次级债务、股权资本。本期债券经联合资信评估有限公司综合评定为 AAA 级。

● 亚开行 10 亿元人民币债券本周发行

亚洲开发银行 13 日 (周四) 在银行间市场发行 10 亿元人民币债券, 债券期限为 10 年。债券的发行利率通过簿记建档的方式确定为 3.34%, 比同期限的另一只由国际金融公司发行的人民币债券低 6 个基点。在簿记建档期间, 总计获得了 28.15 亿元认购资金, 超额认购倍率为 2.815 倍。

● 五年期国债下周发行

财政部 2005 年第十一期记账式国债将于 10 月 18 日采用多种价格方式招标发行。本期国债期限 5 年, 计划发行 300 亿元。本期国债将通过全国银行间债券市场、证券交易所市场发行, 计划发行面值总额为 300 亿元。追加的基本承销总额控制在甲类成员当期国债中标额的 30% 以内。

● 国开行将发行两只浮息债

国开行将于 10 月 19 日分别发行第 21 和第 22 期金融债, 发行同为 100 亿元。两期债券均为浮动利率债券, 期限分别为十年和五年。其中, 21 期债利率基准为 1 年期定期存款利率, 发行总量 100 亿元; 22 期债基准利率为中国外汇交易中心公布的 7 天回购利率平均值, 发行总量 100 亿元。

● 三只短期融资券将于下周发行

北京首创、江西赣粤高速、中国铁路物资等三只短期融资券将于下周在银行间债券市场发行。其中, 北京首创首期短期融资券的发行量为 10 亿元, 期限 364 天, 簿记建档的时间为 10 月 18 日, 发行价格为 97.16 元, 经联合资信评估有限公司综合评定短期信用级别为 A-1+ 级。江西赣粤高速首期短期融资券的发行量为 10 亿元, 期限为 364 天, 簿记建档时间为 10 月 18 日, 定价区间为 97.16 元至 97.14 元。中国铁路物资则发行两期短期融资券, 簿记建档时间同为 10 月 19 日, 其中第一期发行量为 5 亿元, 期限为 1 年, 发行价格为 97.16 元; 第二期的发行量为 5 亿元, 期限为 9 个月, 发行价格为 98.02 元。

● 国开行成功发行 10 亿美元全球债券

国家开发银行日前在纽约成功发行 10 亿美元的全球债券。这是该行 2004 年成功发行全球债券后再次进入国际资本市场筹资。据悉, 此次发行的债券规模为 10 亿美元, 期限 10 年, 票面利率为 5%, 分别被穆迪、标普和惠誉评级公司评为 A2、A- 及 A- 等级, 与中国主权信用评级完全一致。该债券得到了来自美国、欧洲和亚洲众多机构投资者的热烈响应。根据统计, 申购总量达到发行额的 6.3 倍, 取得了圆满成功。

本周央行公开市场业务 2005-10-10 — 10-14

票据发行

债券代码	债券简称	发行日期	发行总额 (亿元)	发行价格 (元)	发行方式	计息方式	参考收益率	债券期限 (年)	起息日期	到期日期	上市日期
0501096	05 央行票据 96	2005-10-11	300	98.69	价格招标	贴现	1.3274	1	2005-10-12	2006-10-12	2005-10-12
0501097	05 央行票据 97	2005-10-13	400	99.71	价格招标	贴现	1.1666	0.25	2005-10-14	2006-01-13	2005-10-14
0501098	05 央行票据 98	2005-10-13	200	99.39	价格招标	贴现	1.2309	0.5	2005-10-14	2006-04-14	2005-10-14

回购发行

交易日期	回购品种	回购交易类型	回购交易方式	招标数量 (亿元)	招标利率 (%)
2005-10-11	28 天	正回购	利率招标	100	1.02

票据到期

债券代码	债券简称	发行日期	发行总额 (亿元)	发行价格 (元)	发行方式	计息方式	参考收益率	债券期限 (年)	起息日期	到期日期	上市日期
0401077	04 央行票据 77	2004-10-12	240	96.64	价格招标	贴现	3.4768	1	2004-10-13	2005-10-13	2004-10-13
0501073	05 央行票据 73	2005-07-14	150	99.72	价格招标	贴现	1.1262	0.25	2005-07-15	2005-10-14	2005-07-15

回购到期

交易日期	回购品种	回购交易类型	回购交易方式	招标数量 (亿元)	招标利率 (%)
2005-09-13	28 天	正回购	利率招标	100	1.01

合计

票据回笼净额 (亿元)	回购回笼净额 (亿元)	发行回笼 (亿元)	到期投放 (亿元)	净回笼总额 (亿元)
310	0	1000	690	310

下周债市预告 2005-10-17 — 10-21

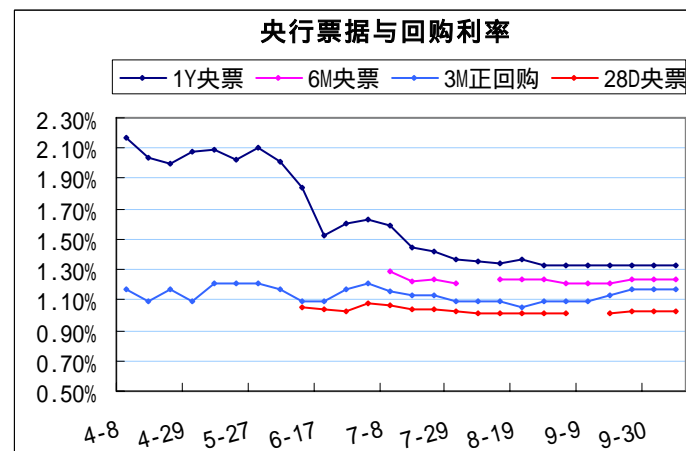
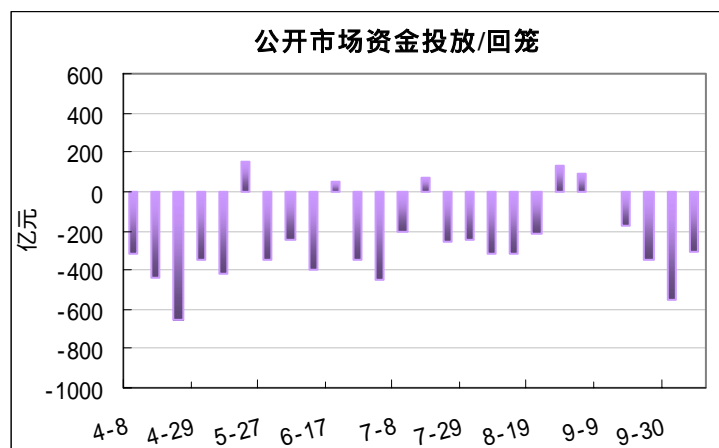
票据到期

债券代码	债券简称	发行日期	发行总额 (亿元)	发行价格 (元)	发行方式	计息方式	参考收益率	债券期限 (年)	起息日期	到期日期	上市日期
401079	04 央行票据 79	2004-10-19	400	96.62	价格招标	贴现	3.4982	1	2004-10-20	2005-10-20	2004-10-20
501075	05 央行票据 75	2005-07-21	150	99.72	价格招标	贴现	1.1262	0.25	2005-07-22	2005-10-21	2005-07-22

回购到期

交易日期	回购品种	回购交易类型	回购交易方式	招标数量 (亿元)	招标利率 (%)
2005-09-20	28 天	正回购	利率招标	100	1.02

近 26 周央行公开市场操作情况



图中纵轴正值表示资金投放，负值表示资金回笼。横轴为各周末。

本周交易所回购收盘行情相关数据 2005-10-10 — 10-14

代码	简称	周收盘(%)	前周收盘(%)	周涨跌(%)	周成交额(亿元)	周成交增额(亿元)	周成交额增幅(%)
201008	R001	1.615	2.230	-27.580	98.181	4.301	104.58
201009	R002	2.605	6.050	-56.940	1.427	0.352	132.74
201000	R003	1.880	3.775	-50.200	11.972	2.577	127.43
201010	R004	1.440	4.010	-64.090	10.562	6.735	275.99
201001	R007	1.365	0.535	155.140	190.360	133.776	336.42
201002	R014	1.500	0.700	114.290	40.947	-60.516	40.36
201003	R028	1.495	1.150	30.000	53.560	-34.814	60.61
201004	R091	1.720	1.740	-1.150	8.355	2.794	150.24
201005	R182	1.980	1.800	10.000	3.675	2.233	254.85
202001	RC001	1.260	2.340	-46.150	12.723	7.568	246.81
202003	RC003	2.050	4.300	-52.330	5.368	5.291	6971.43
202007	RC007	1.500	0.700	114.290	11.127	-1.167	90.51

本周交易所国债行情相关数据 2005-10-10 — 10-14

代码	简称	到期日	期限 (年)	剩余期 限(年)	票面利 率(%)	发行总 额(亿)	应计利 息(元)	收盘净 价(元)	周涨跌 (元)	周涨跌 幅(%)	周振 幅(%)	周成交额 (亿元)	周成交增 额(亿元)	周成交额 增幅(%)	到期收 益率(%)	修正 久期	凸性
010502	05国债(2)	2006-3-15	1	0.42	—	300.00	—	99.45	0.00	0.00	0.070	2.5159	1.9544	3.48	1.33	0.41	0.57
010506	05国债(6)	2006-6-14	1	0.67	—	353.80	—	99.09	-0.14	-0.14	0.380	0.0056	0.0003	0.06	1.38	0.66	1.08
000696	96国债(6)	2006-6-14	10	0.67	11.83	255.30	3.99	107.32	-0.96	-0.89	1.050	0.0489	0.0114	0.30	0.71	0.66	1.09
010405	04国债(5)	2006-6-15	2	0.67	—	635.30	—	99.17	-0.04	-0.04	0.130	3.9118	1.7972	0.85	1.25	0.66	1.09
010510	05国债(10)	2006-9-15	1	0.92	—	331.70	—	99.09	-0.01	-0.01	0.300	0.0537	0.0122	0.29	1.00	0.91	1.73
010411	04国债(11)	2006-12-15	2	1.17	2.98	256.60	2.48	101.95	-0.05	-0.05	0.310	0.2704	0.1246	0.85	1.28	1.13	2.41

代码	简称	到期日	期限 (年)	剩余期 限(年)	票面利 率(%)	发行总 额(亿)	应计利 息(元)	收盘净 价(元)	周涨跌 (元)	周涨跌 幅(%)	周振 幅(%)	周成交额 (亿元)	周成交增 额(亿元)	周成交额 增幅(%)	到期收 益率(%)	修正 久期	凸性
010507	05 国债(7)	2007-7-15	2	1.75	1.58	350.80	0.40	100.03	0.20	0.20	0.360	0.0314	0.0192	1.57	1.56	1.71	4.62
009905	99 国债(5)	2007-8-20	8	1.85	3.28	160.00	0.50	103.05	-0.13	-0.13	0.830	0.2087	-0.0359	-0.15	1.59	1.79	4.99
009704	97 国债(4)	2007-9-5	10	1.89	9.78	130.00	1.07	117.15	-0.05	-0.04	0.540	0.1605	0.1391	6.50	0.62	1.80	5.10
010214	02 国债 14	2007-10-24	5	2.03	2.65	224.00	2.58	101.27	0.01	0.01	0.130	6.8959	4.4554	1.83	2.00	1.91	5.65
010010	20 国债(10)	2007-11-14	7	2.09	R+ .38	120.00	2.17	101.12	0.03	0.03	0.140	3.9257	1.6161	0.70	1.80	1.98	5.98
010103	21 国债(3)	2008-4-24	7	2.53	3.27	120.00	1.56	102.92	0.03	0.03	0.160	1.2331	-0.2402	-0.16	2.06	2.38	8.16
010508	05 国债(8)	2008-8-15	3	2.84	1.93	324.50	0.32	99.94	-0.11	-0.11	0.340	0.0055	-0.2022	-0.97	1.95	2.73	10.19
010115	21 国债(15)	2008-12-18	7	3.18	3.00	200.00	2.47	102.36	0.06	0.06	0.310	2.9887	-1.1046	-0.27	2.22	2.94	11.90
010403	04 国债(3)	2009-4-20	5	3.52	4.42	641.60	2.15	107.92	0.07	0.06	0.460	0.5306	0.1369	0.35	2.05	3.21	13.96
010210	02 国债(10)	2009-8-16	7	3.84	2.39	200.00	0.39	99.83	0.35	0.35	0.630	2.0124	-1.1520	-0.36	2.43	3.61	16.87
009908	99 国债(8)	2009-9-23	10	3.95	3.30	200.00	0.20	103.16	0.21	0.20	0.300	10.1079	7.5266	2.92	2.45	3.67	17.42
010408	04 国债(8)	2009-10-20	5	4.02	4.30	336.10	4.24	108.65	0.85	0.79	1.340	0.3182	0.2523	3.83	2.03	3.57	17.20
010215	02 国债 15	2009-12-6	7	4.15	2.93	340.00	2.51	102.60	0.32	0.31	0.450	1.4179	0.9092	1.79	2.26	3.79	18.77
010301	03 国债(1)	2010-2-19	7	4.35	2.66	700.00	1.73	101.60	0.49	0.48	0.610	4.2508	2.6293	1.62	2.27	4.01	20.66
010503	05 国债(3)	2010-4-26	5	4.53	3.30	333.90	1.56	104.05	0.06	0.06	0.620	0.1427	0.1095	3.30	2.34	4.13	21.90
010004	20 国债(4)	2010-5-23	10	4.61	R+ .62	140.00	1.03	101.68	0.44	0.43	0.490	1.5553	0.2130	0.16	2.21	4.27	23.03
010307	03 国债(7)	2010-8-20	7	4.85	2.66	360.00	0.41	101.60	0.09	0.09	1.280	0.9295	0.6042	1.86	2.31	4.50	25.27
010311	03 国债(11)	2010-11-19	7	5.10	3.50	310.00	3.16	105.40	0.18	0.17	0.300	0.1241	-1.9075	-0.94	2.36	4.52	26.33
010404	04 国债(4)	2011-5-25	7	5.61	4.89	317.50	1.92	113.09	0.63	0.56	0.770	0.0726	-0.1456	-0.67	2.37	4.89	30.44
010407	04 国债(7)	2011-8-25	7	5.87	4.71	312.90	0.66	112.56	0.96	0.86	1.410	0.6356	0.4395	2.24	2.39	5.15	33.28
010110	21 国债(10)	2011-9-25	10	5.95	2.95	200.00	0.16	100.78	0.78	0.78	1.250	4.4119	2.2243	1.02	2.80	5.39	35.52
010112	21 国债(12)	2011-10-30	10	6.05	3.05	200.00	2.92	101.39	0.94	0.94	1.400	2.4849	-1.1924	-0.32	2.80	5.31	35.47
010410	04 国债(10)	2011-11-25	7	6.12	4.86	359.10	4.31	113.02	0.30	0.27	0.860	0.0371	0.0010	0.03	2.53	5.15	34.38
010203	02 国债(3)	2012-4-18	10	6.52	2.54	200.00	1.25	97.85	1.09	1.13	1.460	1.7055	-0.5654	-0.25	2.90	5.83	41.57
010505	05 国债(5)	2012-5-25	7	6.62	3.37	307.80	1.32	104.50	0.19	0.18	0.800	0.0544	0.0106	0.24	2.62	5.83	41.89
010509	05 国债(9)	2012-8-25	7	6.87	2.83	319.40	0.40	102.20	0.80	0.79	1.760	0.1498	0.0653	0.77	2.48	6.17	46.02

代码	简称	到期日	期限 (年)	剩余期 限(年)	票面利 率(%)	发行总 额(亿)	应计利 息(元)	收盘净 价(元)	周涨跌 (元)	周涨跌 幅(%)	周振 幅(%)	周成交额 (亿元)	周成交增 额(亿元)	周成交额 增幅(%)	到期收 益率(%)	修正 久期	凸性
010308	03 国债(8)	2013-9-17	10	7.93	3.02	163.80	0.23	99.82	0.83	0.84	1.390	2.5236	0.3195	0.14	3.04	6.94	58.04
010501	05 国债(1)	2015-2-28	10	9.38	4.44	300.00	0.58	111.95	1.32	1.19	1.310	0.1809	-0.0065	-0.03	3.03	7.92	74.42
010213	02 国债 13	2017-9-20	15	11.94	2.60	240.00	0.18	92.89	1.22	1.33	1.990	3.8440	1.5677	0.69	3.33	9.93	113.33
010107	21 国债(7)	2021-7-31	20	15.81	4.26	240.00	0.89	109.90	1.70	1.57	2.000	2.1818	0.8120	0.59	3.44	11.50	164.27
010303	03 国债(3)	2023-4-17	20	17.52	3.40	260.00	1.69	99.04	1.42	1.45	1.990	7.4969	4.5271	1.52	3.47	13.13	215.38
010504	05 国债(4)	2025-5-15	20	19.60	4.11	339.20	1.72	109.05	1.50	1.39	2.150	0.5437	0.3800	2.32	3.48	13.69	241.93

本周交易所企业债行情相关数据 2005-10-10 — 10-14

代码	简称	到期日	期限 (年)	剩余期 限(年)	票面利 率(%)	发行总 额(亿)	应计利 息(元)	收盘全 价(元)	周涨跌 (元)	周涨跌 幅(%)	周振 幅(%)	周成交额 (亿元)	周成交增 额(亿元)	周成交额 增幅(%)	到期收 益率(%)	修正 久期	凸性
120206	02 武钢(3)	2005-11-5	3	0.06	3.50	5.00	10.30	110.35	-0.13	-0.12	0.260	0.1007	0.0599	1.47	2.28	0.06	0.06
129904	98 中信(7)	2006-6-16	7	0.67	5.48	7.00	1.82	104.16	-0.22	-0.21	0.450	0.0058	-0.0031	-0.35	1.89	0.66	1.08
129805	98 三峡(8)	2007-1-18	8	1.26	6.20	10.00	4.59	109.57	0.34	0.31	0.520	0.1541	0.1204	3.57	2.13	1.18	2.60
129905	98 石油债	2007-9-8	8	1.90	4.50	13.50	0.46	104.85	0.46	0.44	1.200	0.5098	0.4814	16.95	2.11	1.82	5.14
120202	02 中移(5)	2007-10-28	5	2.04	3.50	30.00	3.38	105.97	0.80	0.76	0.850	0.2438	0.2163	7.87	2.18	1.90	5.61
111016	01 广核债	2008-12-11	7	3.16	4.12	25.00	3.48	106.30	0.55	0.52	1.140	0.0171	0.0056	0.49	3.16	2.84	11.29
129902	98 中铁(3)	2009-10-13	10	4.00	4.50	24.00	0.02	104.24	-3.34	-2.69	3.620	0.1040	0.0621	1.48	3.35	3.63	17.18
120207	02 武钢(7)	2009-11-5	7	4.06	4.02	15.00	3.79	106.25	1.10	1.05	1.170	0.2400	0.2277	18.51	3.36	3.57	17.15
129903	99 三峡债	2010-7-25	10	4.78	R+1.75	30.00	0.84	102.59	0.39	0.38	0.560	0.0198	0.0070	0.55	3.32	4.29	23.44
120101	01 中移动	2011-6-18	10	5.68	R+1.75	50.00	1.22	102.86	0.38	0.37	0.710	0.0168	-0.0130	-0.44	3.40	5.00	31.34
111015	01 三峡 10	2011-11-8	10	6.07	R+1.75	20.00	3.48	104.97	0.46	0.44	0.730	0.0046	-0.0025	-0.35	3.45	5.19	34.33
120288	02 金茂债	2012-4-28	10	6.54	4.22	10.00	1.97	104.40	0.18	0.17	0.840	0.0044	-0.0028	-0.39	3.79	5.54	38.72
120205	02 渝城投	2012-12-9	10	7.16	4.32	15.00	3.67	106.70	0.49	0.46	0.750	0.0039	-0.0001	-0.03	3.82	5.88	44.20
120307	03 浦发债	2013-1-13	10	7.26	4.29	15.00	3.23	105.66	0.46	0.44	1.230	0.0115	0.0101	7.21	3.89	5.97	45.34

代码	简称	到期日	期限 (年)	剩余期 限(年)	票面利 率(%)	发行总 额(亿)	应计利 息(元)	收盘全 价(元)	周涨跌 (元)	周涨跌 幅(%)	周振 幅(%)	周成交额 (亿元)	周成交增 额(亿元)	周成交额 增幅(%)	到期收益 率(%)	修正 久期	凸性
120308	03 沪杭甬债	2013-1-24	10	7.29	4.29	10.00	3.10	105.65	0.60	0.57	0.970	0.0125	-0.0026	-0.17	3.88	6.00	45.74
120302	03 苏园建	2013-7-18	10	7.76	4.30	10.00	1.05	103.94	0.72	0.70	0.780	0.0090	0.0051	1.31	3.86	6.46	51.95
111021	03 华能2	2013-12-9	10	8.16	R+1.8	10.00	3.21	104.30	0.30	0.29	0.290	0.0001	0.0001	0.00	3.62	6.71	56.68
111020	03 华能1	2013-12-9	10	8.16	4.60	30.00	3.91	108.50	-0.32	-0.29	1.060	0.0021	-0.0149	-0.88	3.93	6.51	54.30
120304	03 电网(1)	2013-12-31	10	8.22	4.61	30.00	3.64	108.22	0.77	0.72	1.380	0.0188	-0.0037	-0.16	3.94	6.56	55.07
120305	03 电网(2)	2013-12-31	10	8.22	R+1.75	20.00	2.94	104.00	0.46	0.44	0.530	0.0006	-0.0001	-0.14	3.58	6.79	57.72
111022	04 首旅债	2014-2-19	10	8.36	R+1.75	10.00	2.43	103.70	0.70	0.68	0.330	0.0004	0.0001	0.33	3.55	6.92	59.71
120483	04 中石化	2014-2-24	10	8.37	4.61	35.00	2.94	108.61	1.68	1.57	1.130	0.0037	0.0020	1.18	3.80	6.72	57.37
120482	04 通用债	2014-3-31	10	8.47	R+1.75	10.00	2.02	103.90	0.90	0.87	1.170	0.0019	0.0009	0.90	3.47	7.04	61.43
120485	04 国电(1)	2014-9-22	10	8.95	5.30	24.44	0.33	111.15	0.65	0.59	0.910	0.0336	0.0116	0.53	3.84	7.14	63.96
111024	04 华电1	2014-9-29	10	8.96	5.40	29.80	0.24	112.29	1.09	0.98	3.930	0.0017	-0.0790	-0.98	3.79	7.15	64.14
120488	04 京地铁	2014-12-15	10	9.18	R+2.72	20.00	3.91	116.95	3.80	3.36	3.040	0.0003	-0.0015	-0.83	3.05	7.28	67.66
120501	05 申能债	2015-2-2	10	9.31	R+2.7	10.00	3.27	112.00	0.00	0.00	0.000	0.0001	0.0001	0.00	3.56	7.34	68.62
120503	05 渝水务	2015-4-26	10	9.54	5.05	17.00	2.38	111.00	0.60	0.54	0.910	0.0014	-0.0005	-0.26	3.94	7.42	70.15
120502	05 苏园建	2015-5-19	10	9.60	5.05	12.00	2.06	111.01	1.01	0.92	1.320	0.0030	0.0009	0.43	3.91	7.49	71.19
120505	05 华电债	2015-6-30	10	9.72	4.98	20.00	1.46	110.10	0.91	0.83	0.750	0.0149	-0.0098	-0.40	3.89	7.62	73.21
120509	05 国网(1)	2015-7-8	10	9.74	4.98	30.00	1.35	109.98	0.30	0.27	4.570	0.0280	-0.0244	-0.47	3.89	7.64	73.55
120510	05 国网(2)	2015-7-8	10	9.74	R+2.25	10.00	1.15	107.50	0.00	0.00	0.020	0.0003	-0.0033	-0.92	3.45	7.88	76.94
120516	05 中电投	42197	10	9.75	4.98	20.00	1.30	109.90	0.50	0.46	0.46	0.034	-0.0743	-0.69	3.90	7.65	73.71
120511	05 沪建(1)	42212	10	9.79	4.98	20.00	1.09	109.31	0.31	0.28	0.83	0.0328	-0.1649	-0.83	3.95	7.68	74.24
120102	01 三峡债	2016-11-8	15	11.08	5.21	30.00	4.87	115.82	1.32	1.15	1.180	0.0548	0.0224	0.69	3.97	8.13	86.81
111018	02 电网15	2017-6-19	15	11.69	4.86	35.00	1.57	109.31	1.30	1.20	4.760	0.0061	0.0045	2.81	4.01	8.81	98.65
120203	02 中移(15)	2017-10-28	15	12.05	4.50	50.00	4.34	109.88	1.58	1.46	1.550	1.1058	1.0846	51.16	3.91	8.90	102.95
111019	02 广核债	2017-11-11	15	12.09	4.50	40.00	4.17	108.89	1.01	0.94	0.940	0.0152	-0.1117	-0.88	4.00	8.92	103.29
120204	02 苏交通	2017-12-12	15	12.17	4.51	15.00	3.79	108.61	0.82	0.76	1.000	0.0307	-0.0146	-0.32	4.00	9.00	104.76
120301	03 沪轨债	2018-2-19	15	12.36	4.51	40.00	2.94	107.80	0.60	0.56	1.420	0.0199	-0.1204	-0.86	4.00	9.18	108.24

代码	简称	到期日	期限 (年)	剩余期 限(年)	票面利 率(%)	发行总 额(亿)	应计利 息(元)	收盘全 价(元)	周涨跌 (元)	周涨跌 幅(%)	周振 幅(%)	周成交额 (亿元)	周成交增 额(亿元)	周成交额 增幅(%)	到期收益 率(%)	修正 久期	凸性
120306	03 中电投	2018-12-8	15	13.16	5.02	30.00	4.28	114.45	1.30	1.15	1.150	0.0084	-0.0003	-0.03	4.01	9.36	115.42
120486	04 国电(2)	2019-9-22	15	13.95	5.60	15.56	0.35	115.52	0.02	0.02	0.020	0.0017	0.0006	0.55	4.14	9.89	126.62
120506	05 大唐债	2020-4-29	15	14.55	5.28	30.00	2.44	115.00	1.01	0.89	0.880	0.0016	0.0013	4.33	4.11	10.13	134.81
120512	05 沪建(2)	44039	15	14.8	5.18	10.00	1.14	113.18	0.68	0.6	0.6	0.0721	-0.0221	-0.23	4.08	10.41	140.78
120508	05 铁道债	2020-7-29	15	14.80	4.85	50.00	1.04	110.00	1.20	1.10	0.000	0.0000	-0.0005	-1.00	4.03	10.55	143.60
111023	03 中铁债	2021-8-25	18	15.87	4.63	30.00	0.65	107.51	0.93	0.87	0.850	0.0052	-0.1208	-0.96	4.03	11.22	162.30
120201	02 三峡债	2022-9-20	20	16.95	4.76	50.00	0.33	109.51	1.11	1.02	0.930	1.8542	1.2186	1.92	4.00	11.73	178.73
120303	03 三峡债	2033-8-1	30	27.82	4.86	30.00	1.00	110.99	-0.01	-0.01	0.930	0.1204	-0.4271	-0.78	4.24	15.58	346.60

本周可转债行情相关数据 2005-10-10 — 10-14

代码	简称	周收盘 (元)	周涨跌 (元)	周涨跌 幅(%)	周振幅 (%)	周成交 额(亿元)	周成交增 额(亿元)	周成交额 增幅(%)	实际转股 价(元/股)	转换价值 (元)	债券转股溢 价率(%)	转换平价 (元)	基础股票周 涨跌幅(%)	基础股票周 收盘价(元)	基础股 票简称
100087	水运转债	99.100	-0.400	-0.40	0.610	0.0168	0.0067	0.66	5.56	74.82	32.45	5.51	0.000	4.160	南京水运
126301	丝绸转2	99.200	-0.500	-0.50	0.840	0.1571	-0.1747	-0.53	3.00	80.00	24.00	2.98	-2.440	2.400	丝绸股份
100117	西钢转债	100.570	0.110	0.11	0.910	0.1265	-0.0033	-0.03	5.34	52.81	90.44	5.37	-3.090	2.820	西宁特钢
125936	华西转债	101.500	-0.490	-0.48	1.470	0.1065	0.1065	0.00	6.46	66.72	52.13	6.56	17.120	4.310	华西村
125959	首钢转债	102.200	0.000	0.00	0.000	0.0000	-0.5126	-1.00	3.63	92.29	10.74	3.71	0.000	3.350	首钢股份
110219	南山转债	102.800	-0.680	-0.66	0.870	0.2020	-0.1359	-0.40	6.50	91.85	11.93	6.68	0.000	5.970	南山实业
125729	燕京转债	102.800	-3.600	-3.38	4.150	0.1440	-0.1658	-0.54	7.06	85.55	20.16	7.26	-7.080	6.040	燕京啤酒
125488	晨鸣转债	102.970	-1.820	-1.74	5.650	0.1343	-0.1981	-0.60	6.59	73.60	39.91	6.79	-7.620	4.850	晨鸣纸业
110874	创业转债	103.490	-0.510	-0.49	1.660	0.0046	-0.0033	-0.42	6.08	62.01	66.90	6.29	0.800	3.770	创业环保
125932	华菱转债	103.820	0.360	0.35	0.820	0.9816	-0.1684	-0.15	4.40	97.50	6.48	4.57	1.180	4.290	华菱管线
125937	金牛转债	104.000	0.000	0.00	0.000	0.0000	0.0000	0.00	6.44	90.06	15.48	6.70	2.290	5.800	金牛能源
125822	海化转债	104.090	-1.910	-1.80	3.130	0.0936	-0.1345	-0.59	4.70	99.57	4.53	4.89	0.650	4.680	山东海化

代码	简称	周收盘 (元)	周涨跌 (元)	周涨跌 幅(%)	周振幅 (%)	周成交 额(亿元)	周成交增 额(亿元)	周成交额 增幅(%)	实际转股 价(元/股)	转换价值 (元)	债券转股溢 价率(%)	转换平价 (元)	基础股票周 涨跌幅(%)	基础股票周 收盘价(元)	基础股 票简称
110001	邯钢转债	104.430	-0.280	-0.27	0.700	0.5846	0.1145	0.24	3.36	94.05	11.04	3.51	-1.250	3.160	邯钢钢铁
100196	复星转债	104.480	-2.750	-2.56	3.590	0.0392	0.0008	0.02	5.03	91.25	14.50	5.26	-5.750	4.590	复星实业
110317	营港转债	104.800	-0.700	-0.66	0.960	0.5477	0.2752	1.01	10.25	85.66	22.35	10.74	-8.160	8.780	营口港
110036	招行转债	104.800	-1.450	-1.36	1.350	2.3712	-0.1335	-0.05	6.23	101.12	3.64	6.53	0.160	6.300	招商银行
100236	桂冠转债	105.430	0.310	0.29	0.470	0.2154	-0.1011	-0.32	6.18	75.24	40.12	6.52	3.560	4.650	桂冠电力
100567	山鹰转债	105.480	-1.070	-1.00	1.920	0.1149	0.0920	4.02	3.32	103.01	2.40	3.50	4.910	3.420	山鹰纸业
100726	华电转债	105.500	-0.720	-0.68	1.190	0.0910	-0.0289	-0.24	4.41	74.15	42.28	4.65	-2.100	3.270	华电能源
110010	包钢转债	107.410	-2.370	-2.16	2.790	0.3352	-0.1675	-0.33	4.15	106.27	1.08	4.46	-3.920	4.410	
100795	国电转债	107.800	-1.470	-1.35	2.100	0.2917	0.0241	0.09	6.59	88.92	21.23	7.10	-12.010	5.860	国电电力
100177	雅戈转债	108.020	-4.450	-3.96	3.690	0.0420	-0.0376	-0.47	3.35	105.97	1.93	3.62	-1.660	3.550	雅戈尔
126002	万科转2	108.800	0.000	0.00	0.000	0.0000	-0.2589	-1.00	3.55	101.13	7.59	3.86	0.000	3.590	深万科A
110037	歌华转债	109.590	1.580	1.46	3.930	0.8301	0.4295	1.07	12.35	109.47	0.11	13.53	3.280	13.520	歌华有线
125630	铜都转债	113.600	0.000	0.00	0.000	0.0000	-0.0031	-1.00	4.45	115.96	-2.03	5.06	0.000	5.160	铜都铜业
100016	民生转债	118.620	0.000	0.00	0.000	0.0000	-0.2186	-1.00	4.64	119.83	-1.01	5.50	0.000	5.560	民生银行
110418	江淮转债	130.400	0.000	0.00	0.000	0.0000	-0.4337	-1.00	5.62	131.85	-1.10	7.33	0.000	7.410	江淮汽车
100096	云化转债	137.100	-2.760	-1.97	14.610	0.0189	0.0154	4.40	6.80	135.15	1.45	9.32	-0.110	9.190	云天化
125930	丰原转债	145.010	-3.030	-2.05	13.790	0.1369	-0.2362	-0.63	4.80	159.79	-9.25	6.96	9.100	7.670	丰原生化
125069	侨城转债	158.000	0.000	0.00	0.000	0.0000	0.0000	0.00	6.15	159.35	-0.85	9.72	2.620	9.800	华侨城A

本周可转债基本情况相关数据 2005-10-10 — 10-14

代码	简称	周收盘 (元)	周涨跌 幅(%)	周振幅 (%)	转换期起始日	剩余期 限(年)	债券到期日	债券基准 利率(%)	实际转股 价(元/股)	转换价 值(元)	债券转股 溢价率(%)	转换平 价(元)	基础股票周 收盘价(元)	基础股票周涨 跌幅(%)
100016	民生转债	118.620	0.00	0.00	2003-8-27	2.37	2008-2-27	1.50	4.64	119.83	-1.01	5.50	5.560	0.000
100087	水运转债	99.100	-0.40	0.61	2003-8-13	1.83	2007-8-13	0.90	5.56	74.82	32.45	5.51	4.160	0.000
100096	云化转债	137.100	-1.97	14.61	2004-3-10	0.91	2006-9-10	1.60	6.80	135.15	1.45	9.32	9.190	-0.110
100117	西钢转债	100.570	0.11	0.91	2004-2-11	2.83	2008-8-11	1.20	5.34	52.81	90.44	5.37	2.820	-3.090
100177	雅戈转债	108.020	-3.96	3.69	2003-10-3	0.47	2006-4-3	1.00	3.35	105.97	1.93	3.62	3.550	-1.660
100196	复星转债	104.480	-2.56	3.59	2004-4-28	3.04	2008-10-28	1.60	5.03	91.25	14.50	5.26	4.590	-5.750
100236	桂冠转债	105.430	0.29	0.47	2004-6-30	2.71	2008-6-30	1.10	6.18	75.24	40.12	6.52	4.650	3.560
100567	山鹰转债	105.480	-1.00	1.92	2003-12-16	2.67	2008-6-16	1.50	3.32	103.01	2.40	3.50	3.420	4.910
100726	华电转债	105.500	-0.68	1.19	2003-12-3	2.64	2008-6-3	1.50	4.41	74.15	42.28	4.65	3.270	-2.100
100795	国电转债	107.800	-1.35	2.10	2004-1-18	2.76	2008-7-18	0.80	6.59	88.92	21.23	7.10	5.860	-12.010
110001	邯钢转债	104.430	-0.27	0.70	2004-5-26	3.12	2008-11-26	1.00	3.36	94.05	11.04	3.51	3.160	-1.250
110010	包钢转债	107.410	-2.16	2.79	2005-5-10	4.08	2009-11-10	1.30	4.15	106.27	1.08	4.46	4.410	-3.920
110036	招行转债	104.800	-1.36	1.35	2005-5-10	4.08	2009-11-10	1.00	6.23	101.12	3.64	6.53	6.300	0.160
110037	歌华转债	109.590	1.46	3.93	2004-11-12	3.58	2009-5-12	1.30	12.35	109.47	0.11	13.53	13.520	3.280
110219	南山转债	102.800	-0.66	0.87	2005-4-19	4.02	2009-10-19	1.50	6.50	91.85	11.93	6.68	5.970	0.000
110317	营港转债	104.800	-0.66	0.96	38311	3.60	2009-5-20	1.80	10.25	85.66	22.35	10.74	8.780	-8.160
110418	江淮转债	130.400	0.00	0.00	2004-10-15	3.50	2009-4-15	1.20	5.62	131.85	-1.10	7.33	7.410	0.000
110874	创业转债	103.490	-0.49	1.66	2005-7-1	3.72	2009-7-1	1.70	6.08	62.01	66.90	6.29	3.770	0.800
125069	侨城转债	158.000	0.00	0.00	2004-7-1	1.21	2006-12-31	1.20	6.15	159.35	-0.85	9.72	9.800	2.620
125488	晨鸣转债	102.970	-1.74	5.65	2005-3-15	3.92	2009-9-15	1.50	6.59	73.60	39.91	6.79	4.850	-7.620
125630	铜都转债	113.600	0.00	0.00	2003-11-21	2.60	2008-5-21	1.20	4.45	115.96	-2.03	5.06	5.160	0.000
125729	燕京转债	102.800	-3.38	4.15	2003-10-16	2.01	2007-10-16	1.20	7.06	85.55	20.16	7.26	6.040	-7.080
125822	海化转债	104.090	-1.80	3.13	2005-3-7	3.90	2009-9-7	1.50	4.70	99.57	4.53	4.89	4.680	0.650
125930	丰原转债	145.010	-2.05	13.79	2003-10-27	2.53	2008-4-24	1.80	4.80	159.79	-9.25	6.96	7.670	9.100

代码	简称	周收盘 (元)	周涨跌 幅(%)	周振幅 (%)	转换期起始日	剩余期 限(年)	债券到期日	债券基准 利率(%)	实际转股 价(元/股)	转换价 值(元)	债券转股 溢价率(%)	转换平 价(元)	基础股票周 收盘价(元)	基础股票周涨 跌幅(%)
125932	华菱转债	103.820	0.35	0.82	2005-1-16	3.76	2009-7-16	1.00	4.40	97.50	6.48	4.57	4.290	1.180
125936	华西转债	101.500	-0.48	1.47	2004-3-1	2.89	2008-9-1	1.60	6.46	66.72	52.13	6.56	4.310	17.120
125937	金牛转债	104.000	0.00	0.00	2005-2-11	3.83	2009-8-11	1.60	6.44	90.06	15.48	6.70	5.800	2.290
125959	首钢转债	102.200	0.00	0.00	2004-6-16	3.18	2008-12-16	1.50	3.63	92.29	10.74	3.71	3.350	0.000
126002	万科转2	108.800	0.00	0.00	2005-3-24	3.95	2009-9-24	1.00	3.55	101.13	7.59	3.86	3.590	0.000
126301	丝绸转2	99.200	-0.50	0.84	2003-3-10	1.90	2007-9-9	1.80	3.00	80.00	24.00	2.98	2.400	-2.440

指标说明：

转换价值(元) = 基础股票股价 × 100 / 最新转股价

债券转股溢价率(%) = (转债价格 - 转换价值) / 转换价值

转换平价(元) = 转债价格 / (100 / 转股价格)

重要声明：本报告是上海聚源数据服务有限公司为特定客户和专业人士提供的参考资料。本报告中的信息均来源于已公开披露的资料，我公司对这些信息的准确性及完整性不作任何承诺和保证，不保证该信息未经任何更新。在任何情况下，本报告中的信息或观点均不应视为证券投资相关咨询或建议，文中所有内容亦不代表我公司的观点和意见。在任何情况下，上海聚源数据服务有限公司以及与该公司有关联的任何个人均不就本报告中的任何内容对任何投资做出任何形式的担保，不承担因使用本报告而产生的法律责任。本报告版权归上海聚源数据服务有限公司所有，未经上海聚源数据服务有限公司授权不得复印、转发或向特定读者群以外的人士传阅。如需引用或转载本报告，务必与上海聚源数据服务有限公司联系。