

## 国都金融期货早报

### 国都期货研发中心

分析师：王伟辉

执业编号：F0283939

电话：010-84183045

邮箱：[wangweihui@guodu.cc](mailto:wangweihui@guodu.cc)

分析师：徐疆

电话：010-84183067

邮箱：[xujiang@guodu.cc](mailto:xujiang@guodu.cc)

分析师：陈润宵

电话：010-84183022

邮箱：[chenrunxiao@guodu.cc](mailto:chenrunxiao@guodu.cc)

分析师：张见

电话：010-84180311

邮箱：[zhangjian@guodu.cc](mailto:zhangjian@guodu.cc)

本报告中所有数据均来自国都期货。

地址：北京市东城区东直门南大街3号国华投资大厦10层  
国都期货有限公司

网址：[www.guodu.cc](http://www.guodu.cc)

### 【隔夜要闻】

#### 1、美国上周初请失业金人数降至 30.5 万表现强劲

美国劳工部周四公布的数据显示，美国上周初请失业金人数维持在六年低点附近，表明就业状况正在改善。具体数据显示，美国9月21日当周初请失业金人数30.5万人，预期32.5万人，前值修正为31.0万人，初值为30.9万人。

#### 2、上交所：国债预发行计划 10 月 10 日推出

9月26日上交所发布通知明确，国债预发行交易的大宗交易方式暂不实施，具体实施时间由上交所和中国结算另行通知。国债预发行交易履约保证金比例暂定为10%；《办法》第三十三条规定的证券交收不足的补偿金标准，暂定为证券交收不足部分面值的1%。各市场参与者应采取有效措施确保单个参与者净买入余额不得超过当期国债当次计划发行量的6%。

#### 3、国庆假期期货市场休市安排公布

根据国务院安排，2013年国庆节期货市场休市安排为：9月28日(星期六)、9月29日(星期日)为周末休市；9月30日正常开市；10月1日(星期二)至10月7日(星期一)休市，10月8日(星期二)起照常开市；10月12日(星期六)、10月13日(星期日)为周末休市。根据上期所规定，9月30日当晚不进行连续交易。10月8日黄金、白银期货品种集合竞价时间为上午08:55-09:00。10月8日当晚恢复连续交易。



## 【活跃可交割券列表】

附录：SH 代表上海证券交易所，SZ 代表深圳证券交易所，IB 代表银行间市场。

债券的活跃程度可根据债券的成交量确定，即成交量越大的债券，在市场中越活跃。IRR 代表隐含回购利率，具体来说，就是购买国债现货，卖空对于的国债期货，然后持有到期把现货国债用于对于国债期货的交割，这样获得的理论收益率。IRR 越大，对应的可交割券即为最便宜可交割券。

代码	简称	转换因子	交割利息	区间付息	交割成本	期现价差	IRR (%)	基差	收盘全价	收盘净价	收益率 (%)	久期	凸性	成交量 (亿)	票面利率 (%)
101315.SZ	国债1315	1.027	1.5072	--	96.7394	1.8933	8.7115	-1.1254	96.7394	96	4.1444	6.1127	42.4399	0.0035	3.46
019315.SH	13国债15	1.027	1.5072	--	97.2394	1.3933	6.378	-0.6254	97.2394	96.5	4.0565	6.1148	42.5306	0	3.46
101308.SZ	国债1308	1.0164	2.1903	--	96.9302	1.3831	6.3515	-0.653	96.9302	95.47	4.0868	5.9105	39.9758	0.0074	3.29
019308.SH	13国债08	1.0164	2.1903	--	97.1402	1.1731	5.3755	-0.443	97.1402	95.68	4.0487	5.9114	40.0127	0	3.29
101303.SZ	国债1303	1.023	3.0639	--	98.805	1.0061	4.5325	-0.2472	98.805	96.5	4.0536	5.6585	37.1297	0.0018	3.42
130015.IB	13附息国债15	1.027	1.5072	--	97.7072	0.9255	4.2163	-0.1481	97.7072	96.9773	3.975	6.1168	42.615	31.5927	3.46
010512.SH	05国债(12)	1.0403	0.3227	1.825	97.795	0.9109	4.146	-0.1133	99.62	98.27	3.9264	6.261	45.41	0	3.65
130003.IB	13附息国债03	1.023	3.0639	--	98.932	0.8791	3.9553	-0.1108	98.932	96.6364	4.03	5.6591	37.1512	0.0989	3.42
130008.IB	13附息国债08	1.0164	2.1903	--	97.7419	0.5714	2.6022	0.1677	97.7419	96.2907	3.94	5.9139	40.1181	0.3905	3.29
019303.SH	13国债03	1.023	3.0639	--	99.305	0.5061	2.2685	0.2528	99.305	97	3.9608	5.6608	37.2141	0	3.42
120016.IB	12附息国债16	1.0129	0.9082	--	96.3273	0.3729	1.7231	0.3572	96.3273	96.1492	3.99	5.4843	34.2848	0.289	3.25
120005.IB	12附息国债05	1.0196	2.6533	--	99.0336	0.0453	0.2036	0.7208	99.0336	97.1464	4	4.9669	28.8488	0	3.41
019117.SH	11国债17	1.0294	1.6523	--	99.4312	-0.4265	-1.9093	1.2476	99.4312	98.6	4.0226	4.4334	23.1265	0	3.7
019301.SH	13国债01	1.0056	2.9429	--	98.7638	-0.7193	-3.2418	1.4184	98.7638	96.52	4.0442	3.9896	19.1569	0	3.15
101313.SZ	国债1313	1.0036	1.7016	--	97.5159	-0.9018	-4.1164	1.5875	97.5159	96.5	3.9189	4.3792	22.5689	0.0117	3.09
120010.IB	12附息国债10	1.0069	1.6603	--	97.8469	-0.962	-4.3763	1.6675	97.8469	96.892	3.7538	5.2513	31.8571	0	3.14
130013.IB	13附息国债13	1.0036	1.7016	--	97.6628	-1.0487	-4.7797	1.7429	97.6628	96.6554	3.8836	4.3795	22.586	4.6959	3.09
130001.IB	13附息国债01	1.0056	2.9429	--	99.4659	-1.4214	-6.3609	2.1291	99.4659	97.2307	3.86	3.9911	19.2333	0.9948	3.15

### 免责声明：

如果您对本报告有任何意见或建议，请致信于国都信箱 (yfb@guodu.cc)，欢迎您及时告诉我们您对本刊的任何想法！

本刊所有信息均建立在可靠的资料来源基础上。我们力求能为您提供精确的数据，客观的分析和全面的观点。但我们必须声明，对所有信息可能导致的任何损失概不负责。

本报告并不提供量身定制的投资建议。报告的撰写并未虑及读者的

具体财务状况及目标。国都期货研究团队建议投资者应独立评估特定的投资和战略，并鼓励投资者征求专业财务顾问的意见。具体的投资或战略是否恰当取决于投资者自身的状况和目标。

版权声明：(c) 本报告版权为国都期货有限公司所有。本刊所含文字、数据和图表未经国都期货有限公司书面许可，任何人不得以电子、机械、影印、录音或其他任何形式复制、传播或存储于任何检索系统。未经许可，复制本刊任何内容皆属违反版权法行为，可能将受到法律起诉，并承担与之相关的所有损失赔偿和法律费用。涉及版权的所有问题请垂询：010-64000083。