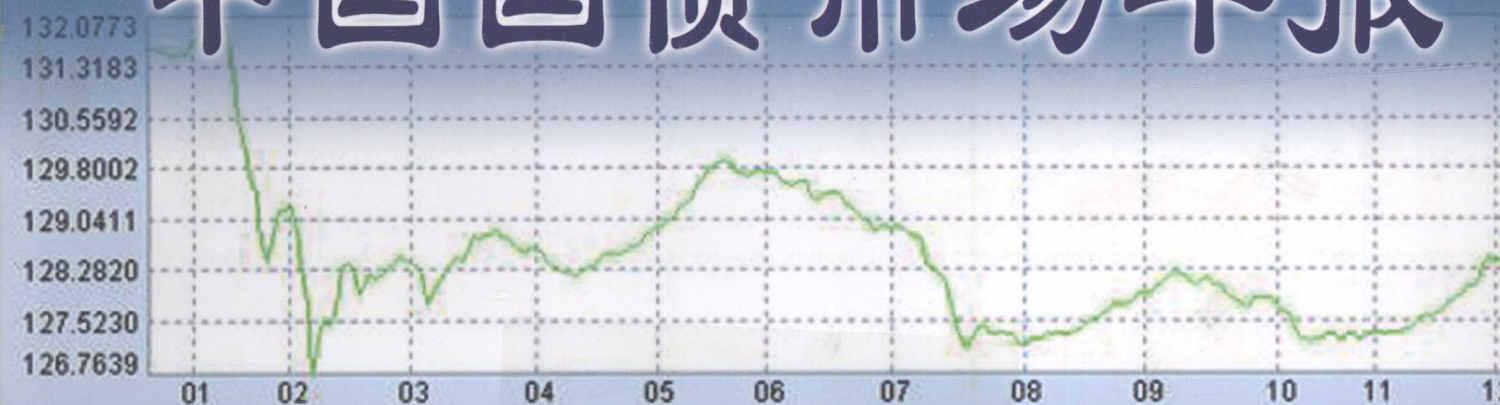


ANNUAL REPORT ANNUAL REPORT ANNUAL REPORT

2009 年

中国国债市场年报



中国国债协会 编

www.ndac.org.cn



中国财政经济出版社

2009 年
中国国债市场年报

中国国债协会 编

中国财政经济出版社

图书在版编目 (CIP) 数据

2009 年中国国债市场年报/中国国债协会编. —北京: 中国财政经济出版社, 2010. 7
ISBN 978 - 7 - 5095 - 2256 - 1

I. ①2... II. ①中... III. ①公债 - 资本市场 - 中国 - 2009 - 年报 IV. ①F812.5

中国版本图书馆 CIP 数据核字 (2010) 第 094159 号

责任编辑: 肖 蕾

责任校对: 李 丽

封面设计: 邹海东

中国财政经济出版社出版

URL: <http://www.cfeph.cn>

E-mail: cfeph@cfeph.cn

(版权所有 翻印必究)

社址: 北京市海淀区阜成路甲 28 号 邮政编码: 100142

发行处电话: 88190406 财经书店电话: 64033436

北京富生印刷厂印刷 各地新华书店经销

880 × 1230 毫米 16 开 32.75 印张 832 000 字

2010 年 8 月第 1 版 2010 年 8 月北京第 1 次印刷

印数: 1—2 000 定价: 54.00 元

ISBN 978 - 7 - 5095 - 2256 - 1/F · 1800

(图书出现印装问题, 本社负责调换)

本社质量投诉电话: 010 - 88190744



2009年5月22日，“中国国债协会第三届理事会第二次会议暨国际经济金融形势报告会”在北京召开，财政部副部长李勇到会祝贺并作国际经济金融形势报告。



中国国债协会常务副会长张秉国在会上作第三届理事会第二次会议工作报告。



财政部金融司巡视员于贞生（左二）、国库支付中心副主任刘金云（右一）出席了会议。中国国债协会副会长王丽丽（右三）主持理事会议，吕世蕴（左一）、杨政（右二）两位副会长出席了会议。



2009年1月16日，“2009-2011年国债承销团组建会议”在深圳召开，财政部部长助理张通在会上作重要讲话。



财政部国库司司长詹静涛（左二）、副司长周成跃（右二）代表财政部与国债承销团成员签署“2009—2011年国债承销主协议”。



中国人民银行国库局局长邵长年（右一）出席“2009-2011年国债承销团组建会议”并讲话。



中国国债协会常务副会长张秉国（图片 中）出席“2009-2011年国债承销团组建会议”并讲话。



2010年1月14日，“2009年国债发行工作总结暨表彰大会”在广州召开。财政部国库司司长詹静涛作题为“求真务实 开创国债管理新局面”的重要讲话。



财政部国库司副司长周成跃主持“2009年国债发行工作总结暨表彰大会”。

中国人民银行国库局副局长朱苏荣在“2009年国债发行工作总结暨表彰大会”上作题为“协调配合 全面推动国债管理工作迈上新台阶”的重要讲话。



中国证监会市场监管部处长王嫻在“2009年国债发行工作总结暨表彰大会”讲话。



“2009年国债发行工作总结暨表彰大会”上，财政部、中国人民银行、中国证监会有关部门领导向获奖承销团成员颁发奖牌。

第三批“新增储蓄国债（电子式）试点商业银行工作动员暨政策培训会”于2009年6月9日至10日在北京举办。华夏银行、上海银行、南京银行、杭州银行、徽商银行、乌鲁木齐商业银行、长沙银行、天津银行八家商业银行的领导和业务主管近200人参加本次会议和培训。



第四批“新增储蓄国债（电子式）试点商业银行工作动员暨政策培训会”于2009年9月3日至4日在北京举办。深圳发展银行、石家庄商行、青岛银行、大连银行、恒丰银行、包商银行、上海农商银行七家商业银行的领导和业务主管近150人参加本次会议和培训。

2009年7月17日，中国国债协会在哈尔滨市举办“宏观经济形势及债券市场走势报告分析会”，中共中央政策研究室经济研究局局长李连仲到会做宏观经济形势报告。



第五批“新增储蓄国债（电子式）试点商业银行工作动员暨政策培训会”于2009年11月3日至4日在北京举办。上海浦东发展银行、广东发展银行、江苏银行、西安商业银行、宁波银行、汉口银行、齐鲁银行、富滇银行、南昌银行、民生银行、成都银行、晋商银行12家商业银行的领导和业务主管近170人参加本次会议和培训。

2009年11月27日，财政部成功发行首期50年期国债，招标确定的利率为4.30%。至此，我国成为继英、法两国后世界上第三个发行50年期超长期国债的国家。图为财政部国库司领导亲临招标现场视察招标情况。





2009年3月25日至27日，中国国债协会在青岛市举办“金融企业债券会计政策与实务操作培训班”，协会会员和其他金融机构代表共70余人参加培训。

2009年11月4日至6日，中国国债协会在昆明市举办“农村金融改革发展与国债投资管理培训研讨会”，32家农村金融机构的代表50余人参加了培训研讨会。



2009年9月，中国国债协会组织部分会员赴英国进行为期21天的“债券市场管理与风险控制”培训。图为中国国债协会秘书长张红力（前排 中）与全体团员在英国里丁大学国际资本市场协会中心培训时合影。

《2009 年中国国债市场年报》

编辑委员会名单

顾 问：刘鸿儒

主 任：张秉国

副 主 任：（以姓氏笔画为序）

纪志宏 王丽丽 刘世安 吕世蕴 张 颖

张红力 李大春 杨 政 邵长年 周成跃

胡学好 谢 庚 张 漪

委 员：（以姓氏笔画为序）

王 平 王 娴 王勤淮 韦士歌 白 宁

刘慧清 朱 岩 张 玲 张 锐 张翠微

李 平 陈景耀 徐轲燕 莫慧琴 袁伟荣

梁维和

编辑说明

2009 年是我国历史上十分重要的一年。我国经受了国际金融危机的严重考验，经历了新世纪以来经济发展最为困难的岁月。在党中央、国务院的正确领导下，全国各族人民坚定信心、迎难而上、共克时艰，努力化挑战为机遇，按照“保增长、扩内需、调结构”的战略部署，把保持经济平稳较快发展作为经济工作的首要任务，实施积极的财政政策和适度宽松的货币政策，有效遏止了经济增长明显下滑态势，实现经济形势总体回升向好的局面，取得了显著成效。

2009 年，我国金融市场总体运行平稳，债券市场快速发展，充分发挥了保证国家宏观经济政策实施、推动金融体制改革、加大金融支持经济发展力度的积极作用。2009 年也是我国国债市场稳步发展的一年。在财政部、中国人民银行、中国证监会等政府主管部门，以及中国国债协会、中央国债登记结算有限责任公司、上海证券交易所等市场中介机构和国债承销团成员共同努力下，年度国债和地方债筹资任务圆满完成，国债和地方债发行管理取得新进展，国债二级市场交易活跃，国债收益率曲线进一步完善。为落实积极财政政策，2009 年我国加大了国债筹资力度，全年财政部共发行国债 16229 亿元，并首次代理地方政府发行债券 2000 亿元。这一年里，国债发行频率之高、品种之多、发行量之大、单只期限之长，在新中国历史上是首屈一指。

中国国债协会自 2003 年起编辑中国国债市场年报，每年出版一册，已成系列。现奉献给读者的是该系列的第八册。《2009 年中国国债市场年报》共分为五篇：

第一篇为“综合篇”。本篇收入了 2009 年中央经济工作会议的主要精神、政府工作报告（摘要）、国家发展和改革委员会及财政部在全国人民代表大会上的报告（摘要）、中国人民银行货币政策报告（摘要）以及政府各主管部门对发展我国国债市场的思路和观点等，以便读者更好地了解 2009 年中国国债市场发展的宏观经济背景和政府主管部门对我国国债市场改革开放的具体部署。

第二篇为“国债市场”。本篇从政府主管部门、市场中介机构和国债承销团成员等不同角度回顾了 2009 年国债管理、国债一级市场、国债二级市场的整体情况及重大事件。本篇较往年新增加了部分国债承销团成员国债业务介绍。

第三篇为“数据统计”。本篇收入了国债发行、兑付等数据，场内、场外两个交易市场的国债现货交易和回购交易数据资料。

第四篇为“国债管理文告”。本篇收入了财政部、中国人民银行、中国证监会等部

门印发的与国债发行、兑付等各环节相关文件以及国债发行公告,以供读者查阅与研究之用。

第五篇为“附录”。本篇收集了地方政府债券、公开市场操作、金融债券以及主要发达国家国债的发行与交易等数据,为读者提供更为广泛的相关资料。

本年报的编辑工作,得到了财政部、中国人民银行、中国证监会等有关部门领导的高度重视和政策指导;中央国债登记结算有限责任公司、上海证券交易所、深圳证券交易所、中国外汇交易中心暨全国银行间同业拆借中心、部分国债承销团成员等单位在有关篇章和数据收集方面给予了大力支持和帮助,在此一并致谢!

尽管编委会对年报的编辑出版工作作出了不断的努力和改进,但不足、遗漏与错误在所难免,恳请广大读者给予批评指正。

《2009 年中国国债市场年报》编辑部

2010 年 3 月 31 日

目 录

第一篇 综合篇

2009 年中央经济工作会议主要精神	(3)
温家宝总理在第十一届全国人民代表大会第二次会议上的政府工作报告 (摘要)	(7)
关于 2008 年国民经济和社会发展规划执行情况与 2009 年国民经济和社会发展规划草案的报告 (摘要)	国家发展和改革委员会 (14)
关于 2008 年中央和地方预算执行情况与 2009 年中央和地方预算草案的报告	财政部 (18)
2009 年货币政策执行报告 (摘要)	中国人民银行货币政策分析小组 (22)
财政部李勇副部长在中国国债协会第三届理事会第二次会议暨国际经济金融形势报告会上的讲话 (摘要)	(28)
改革创新 扎实推进国债管理和国债市场发展——财政部部长助理张通在 2009 - 2011 年国债承销团组建会议上的讲话	(35)
中国人民银行国库局局长邵长年在 2009 - 2011 年国债承销团组建会议上的讲话	(40)
中国国债协会常务副会长张秉国在 2009 - 2011 年国债承销团组建会议上的讲话	(43)
求真务实 开创国债管理新局面——财政部国库司司长詹静涛在 2009 年国债发行工作总结暨表彰大会上的讲话	(45)
协调配合 全面推动国债管理工作迈上新台阶——中国人民银行国库局副局长朱苏荣在 2009 年国债发行工作总结暨表彰大会上的讲话	(50)
中国国债协会常务副会长张秉国在 2009 年国债发行工作总结暨表彰大会上的讲话	(53)
沉着应对当前挑战, 加快构建统一高效的储蓄国债发行体系——财政部国库司副司长周成跃在新增储蓄国债 (电子式) 试点商业银行工作动员大会上的讲话	(55)
进一步开拓储蓄国债 (电子式) 工作新局面——中国人民银行国库局副局长朱苏荣在新增储蓄国债 (电子式) 试点商业银行工作动员大会上的讲话	(60)
中国国债协会常务副会长张秉国在新增储蓄国债 (电子式) 试点商业银行工作动员大会上的讲话	(64)
2009 年中国货币政策大事记	中国人民银行 (66)

2009 年中国宏观经济与宏观调控大事记	中国国债协会秘书处整理 (70)
----------------------------	------------------

第二篇 国债市场

一、政府主管部门

2009 年国债发行及市场运行情况	财政部国库司 (77)
2009 年凭证式国债和储蓄国债 (电子式) 发行情况综述	中国人民银行国库局 (81)
2009 年交易所债券市场回顾	中国证监会市场监管部 (84)

二、市场中中介机构

中央国债登记结算有限责任公司 2009 年国债市场年度分析报告	(87)
上海证券交易所 2009 年债券市场综述	(96)
深圳证券交易所 2009 年国债市场综述	(97)
中国国债协会 2009 年工作总结及 2010 年工作安排	(99)

三、部分国债承销团成员国债业务介绍 (排名不分先后)

中国工商银行股份有限公司	(107)
中国农业银行股份有限公司	(109)
中国银行股份有限公司	(110)
中国建设银行股份有限公司	(111)
中国邮政储蓄银行有限责任公司	(113)
中国光大银行	(114)
招商银行股份有限公司	(115)
上海浦东发展银行股份有限公司	(116)
上海银行股份有限公司	(118)
天津银行	(120)
南京银行股份有限公司	(122)
包商银行股份有限公司	(124)
中信证券股份有限公司	(125)
中国银河证券股份有限公司	(126)
中银国际证券有限责任公司	(127)
平安证券有限责任公司	(128)
2009 年中国国债市场大事记	中国国债协会秘书处整理 (129)

第三篇 数据统计

历年国家内债发行条件一览表(一)	(139)
历年国家内债发行条件一览表(二)	(145)
2009 年国债发行情况表	(156)
2009 年到期国债情况表	(158)
2009 年记账式国债现券交易情况月度统计表	(159)
2009 年记账式国债柜台交易情况月度统计表	(160)
2009 年全国银行间债券市场国债现券日交易量统计表	(161)
2009 年全国银行间债券市场国债指数统计表	(168)
2009 年全国银行间债券市场国债现券交易结算情况统计表	(175)
2009 年全国银行间债券市场国债交易结算情况月度统计表	(179)
2009 年全国银行间债券市场国债质押式回购交易结算情况统计表	(180)
2009 年全国银行间债券市场国债买断式回购交易结算情况统计表	(181)
2009 年末记账式国债余额剩余期限结构统计表(按持有者结构划分)	(182)
2009 年全国银行间债券市场机构投资者国债现券交易额排名(前 200 名)	(183)
2009 年上海证券交易所国债指数与现券日交易量统计表	(188)
2009 年上海证券交易所国债交易情况月度统计表	(194)
2009 年上海证券交易所国债质押式回购日交易情况统计表	(195)
2009 年上海证券交易所机构投资者国债现券交易额排名	(204)
2009 年上海证券交易所机构投资者国债质押式回购交易额排名	(209)
2009 年深圳证券交易所国债现券交易情况月度统计表	(214)
2009 年深圳证券交易所机构投资者国债现券交易额排名	(215)
1994-2009 年凭证式国债与同期银行储蓄存款利率比较表	(218)
1988 年以来银行储蓄存款利率变动表	(220)

第四篇 国债管理文告

一、综合类

中华人民共和国财政部公告

2009 年 1 月 8 日 2009 年第 1 号	(223)
----------------------------------	-------