

市场概述 Market Overview

【每日市场动态 20171017】债市延续昨日跌势

文/ Vivian Shen

CFETS-NEX 2017/10/17

今日央行公开市场进行了 1000 亿元 7 天期逆回购操作、900 亿元 14 天期逆回购操作，逆回购到期 600 亿，MLF 到期 1280 亿元，资金净投放（含 MLF）20 亿元。Shibor 利率多数上行，其中隔夜品种报 2.6003%，上涨 0.63 个基点；7 天品种报 2.8483%，上涨 0.03 个基点；1 个月品种报 4.0356%，下跌 0.71 个基点；3 个月品种报 4.3711%，上涨 0.43 个基点。

今日银行间市场资金面总体均衡偏松，早盘机构融出不少，但较昨日有所收敛，以隔夜和 7 天为主，临近午盘资金面处于均衡格局，午后减点融出机构较昨日减少，其他期限方面，1 个月融出增多，3 个月跨年资金融出较少。

今日发行的 1 年期、3 年期、10 年期国开行固息增发债中标收益率分别为 3.83%、4.2422%、4.2702%，全场倍数分

别为 2.62 倍、2.82 倍、2.36 倍。国债期货全天震荡下行，尾盘收跌。10 年期国债期货主力合约 T1712 收报 93.995，跌 0.37%，5 年期国债期货主力合约 TF1712 收报 96.790，跌 0.25%。今日资金面较昨日小幅收敛，叠加上周国内金融和贸易数据均超预期表现、十九大会议召开在即、三季度国内 GDP 增速等宏观数据尚未出炉，债市情绪维持谨慎，收益率持续走高。截至目前，剩余期限 9.86 年的国开债活跃券 170215 收益率报 4.35%/4.3375%；剩余期限 9.80 年的国债活跃券 170018 收益率报 3.7475%/3.73%。

周二人民币兑美元中间价报 6.5883，较上个交易日下调 44 点。在岸人民币兑美元早盘低开低走，随后横盘震荡，午后跌幅扩大，截至 16:30，在岸人民币兑美元报收 6.6160，较上一交易日收盘价

下跌 248 点；离岸人民币兑美元全天走跌，现报 6.6104，较上一交易日收盘价跌 271 点，两岸汇差目前倒挂在 75 点附近。美元指数整体维持震荡上行态势，尾盘略有回落，现报 93.42，较上一交易日收盘价上涨 0.15%。

以上仅供参考，谢谢！

如果您对本文有任何评论和见解

请发电邮至：shmarketing@cfets-nex.com.cn

更多信息，请登录网站：www.cfets-nex.com.cn

免责声明 文中信息均来源于公开资料，上海国际货币经纪有限责任公司对这些信息的准确性和完整性不作任何保证，内容和意见仅供参考。本文仅反映作者个人观点，并不代表公司的看法。