

市场概述

Market Overview

【每日市场动态 20171213】国债期货弱势震荡

文/ Vivian Shen

CFETS-NEX 2017/12/13

今日中国央行公开市场进行了 700 亿元 7 天逆回购操作、600 亿元 28 天期逆回购操作，逆回购到期 700 亿，资金净投放 600 亿元。Shibor 利率全线上涨，其中隔夜品种报 2.7880%，上涨 6.20 个基点；7 天品种报 2.8510%，上涨 2.10 个基点；1 个月品种报 4.5240%，上涨 3.42 个基点；3 个月品种报 4.8039%，上涨 0.49 个基点。

今早银行间市场流动性偏紧，开盘伊始大行少量融出隔夜，买盘需求旺盛，10 时左右有股份制融出隔夜资金，流动性部分得以缓和，午后隔夜卖盘继续增加，资金面进一步宽松，临近尾盘转为均衡，其他期限方面，7 天买盘堆积，价格小幅上升，14 天成交较多，21 天期跨年资金价格维持高位，成交较少，3 个月资金价格小幅上涨。

今早财政部续发的 5 年期附息国债加

权收益率为 3.8605%，边际收益率为 3.8873%，全场倍数为 3.34 倍，认购热情旺盛。国债期货早盘低开高走，午后震荡回落，尾盘小幅反弹，涨跌不一。10 年期国债期货主力合约 T1803 收报 92.445，较上个交易日下跌 0.01%，5 年期国债期货主力合约 TF1803 收报 96.165，上涨 0.01%。今早资金面依旧偏紧，且宏观经济数据公布在即、美联储议息会议将近，债市情绪维持谨慎，午后流动性紧势逐步缓和，现券收益率全天高开低走。截至目前，剩余期限 9.70 年的国开债活跃券 170215 收益率报 4.85%/4.845%；剩余期限 9.64 年的国债活跃券 170018 收益率报—%/3.935%。

周三人民币兑美元中间价报 6.6251，较上个交易日下调 89 点。在岸人民币兑美元早盘一路走强，午后震荡下行，回吐部分涨幅，截至 16:30，在岸人民币兑

美元报 6.6203，较上一交易日收盘价上涨 9 点；离岸人民币兑美元早盘走强后小幅回落，现报 6.6244，较上一交易日收盘价上涨 26 点，两岸汇差目前维持在 46 点左右。美元指数震荡走跌后维持震荡，临近尾盘大幅拉涨，现报 94.06，较上一交易日收盘价下跌 0.01%。

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。