

市场概述 Market Overview

【每日市场动态 20171020】债市交投维持谨慎

文/ Vivian Shen

CFETS-NEX 2017/10/20

今日中国央行公开市场进行 500 亿 7 天期逆回购操作、300 亿 14 天期逆回购操作，逆回购到期 200 亿，资金净投放 600 亿。Shibor 利率涨跌互现，其中隔夜品种报 2.5782%，下跌 1.38 个基点；7 天品种报 2.8379%，下跌 0.26 个基点；1 个月品种报 4.0235%，下跌 0.50 个基点；3 个月品种报 4.3758%，上涨 0.21 个基点。今日银行间市场资金面均衡偏松，早盘机构纷纷融出 14 天及以内资金，隔夜多以减点价格融出，午后隔夜维持宽松格局，临近尾盘，隔夜需求增多，但鲜有卖盘。

今早财政部发行的 91 天期贴现国债中标收益率为 3.3219%，全场倍数为 2.16 倍，30 年期附息国债中标收益率为 4.2800%，全场倍数为 2.66 倍。整体而言，今日财政部两期国债招标结果分化，机构需求一般，91 天期贴现国债中标收

益率高于市场预期，30 年期附息国债中标收益率符合市场预期。

国债期货早盘一度冲高，午后震荡回落，收盘涨跌不一。10 年期国债期货主力合约 T1712 收报 94.080，跌 0.08%，5 年期国债期货主力合约 TF1712 收报 96.990，涨 0.03%。今日央行公开市场继续净投放以维稳银行间市场流动性，资金面维持均衡偏松态势，但债市交投依旧谨慎，现券收益率小幅上行。截至目前，剩余期限 9.85 年的国开债活跃券 170215 收益率报 4.315%/4.3125%；剩余期限 9.79 年的国债活跃券 170018 收益率报 3.735%/3.72%。

周五人民币兑美元中间价报 6.6092，较上个交易日上调 1 点。在岸人民币兑美元早盘直线拉涨，随后震荡下跌，回吐部分涨幅，午后再度上行，截至 16:30，在岸人民币兑美元报收 6.62，较上一交

易日收盘价上涨 77 点；离岸人民币兑美元全天震荡下跌，现报 6.6234，较上一交易日收盘价跌 176 点，两岸汇差目前在 29 点附近。美元指数早盘大幅拉升，随后维持震荡，现报 93.53，较上一交易日收涨 0.43%。

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。