

市场概述 Market Overview

【每日市场动态 20171116】现券收益率小幅下行

文/ Ryan Rui

CFETS-NEX 2017/11/16

今日中国公开市场进行了 1600 亿元 7 天逆回购操作、1400 亿元 14 天逆回购操作、300 亿元 63 天期逆回购操作，逆回购到期 200 亿，MLF 到期 1225 亿，资金净投放 3100 亿元（不含 MLF）。Shibor 利率多数上涨，其中隔夜品种报 2.8000%，下跌 0.60 个基点；7 天品种报 2.8860%，维持不变；1 个月品种报 4.0270%，上涨 1.06 个基点；3 个月品种报 4.5656%，上涨 2.01 个基点。央行连续四个交易日大量净投放，早盘大行少量融出隔夜资金，7 天资金融出有限，资金面较昨日稍有好转，呈现均衡偏紧态势，午后 3 点左右，大行、股份制大量融出隔夜资金，市场趋于宽松。

今日发行的 2 年期农发行绿色金融债中标收益率为 4.4800%，投标倍数为 4.38 倍。下午发行的首单 10 年期国开行置换债券中标收益率为 4.6720%，全场倍

数 9.12 倍，边际倍数 2.21 倍。

国债期货早盘小幅高开，随后横盘震荡，全线收红。10 年期国债期货主力合约 T1803 收报 92.725，上涨 0.27%，5 年期国债期货主力合约 TF1803 收报 96.435，上涨 0.13%。债券市场继续回暖，现券收益率震荡走低，截至目前，剩余期限 9.78 年的国开债活跃券 170215 收益率报 4.6925%/4.6875%；剩余期限 9.72 年的国债活跃券 170018 收益率报 3.94%/3.93%。

周四人民币兑美元中间价报 6.6286，较上个交易日下调 23 点。在岸人民币兑美元早盘走弱后维持窄幅震荡，截至 16:30，在岸人民币兑美元报收 6.6327，较上一交易日收盘价下跌 29 点；离岸人民币兑美元震荡偏弱，现报 6.6356，较上一交易日收盘价跌 28 点，两岸汇差目前在 40 点附近。美元指数维持窄幅整理，

临近尾盘宽幅震荡，现报 93.84，较上一交易日收盘价涨 0.03%。

今日外管局公布数据显示，中国 10 月银行结售汇顺差 183 亿元人民币，9 月顺差为 19 亿元。10 月银行代客结售汇顺差 501 亿元，9 月顺差为 218 亿元。整体而言，10 月跨境资金流动延续基本平衡，银行结售汇继续呈现顺差格局。

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。