

市场概述

Market Overview

【每日市场动态 20170515】现券收益率明显下行

文/ Ryan Rui

CFETS-NEX 2017/05/15

今日央行公开市场未进行逆回购操作，亦无逆回购到期，资金零投放零回笼。Shibor 利率涨跌互现，其中隔夜品种报 2.7160%，下跌 7.51 个基点；7 天品种报 2.8833%，下跌 2.74 个基点；1 个月品种报 4.0462%，下跌 0.06 个基点；3 个月品种报 4.4184%，上涨 0.96 个基点。今日银行间市场隔夜资金融出较多，全天维持宽松态势，7 天、14 天资金需求旺盛，但融出相对有限，1 个月及以上期限资金需求不多，市场流动性整体维持宽松态势。

国债期货高开高走，全线收红。10 年期国债期货主力合约 T1709 收报 94.515，涨 0.45%，5 年期国债期货主力合约 TF1709 收报 97.390，涨 0.26%。债市早盘跳涨，收益率大幅低开，随后稍有回升。截至目前，剩余期限 9.91 年的国开债活跃券 170210 收益率报

4.30%/4.2975%；剩余期限 9.98 年的国债活跃券 170010 收益率报 3.61%/3.60%。统计局今早公布 4 月经济数据多数回落，经济下行压力逐步显现。央行货币政策执行报告称，要把握好去杠杆和维护流动性基本稳定的平衡。新华社也发表评论称，处置风险要从全局统筹考虑，不能在处置风险过程中发生新风险。监管部门周末的表态，在一定程度上缓解市场对强监管的忧虑，叠加今日公布的经济数据不及预期，债市反弹明显。

周一人民币兑美元中间价报 6.8852，上调 96 点。在岸人民币兑美元早盘短线走强后迅速回落并维持横盘震荡，午后小幅上升，截止 16:30，报收 6.8976，较上一交易日收盘价上涨 51 点；离岸人民币兑美元全天维持强势，现报 6.8964，较上一交易日收盘价上涨 84 点，两岸汇差目前倒挂在 7 点附近。美元指数全天

震荡下行，现报 99.09，跌 0.08%。元。

上周五（5月12日）CFETS 人民币汇率指数录得 93.06，按周上涨 0.06；参考 BIS、SDR 货币篮子的人民币汇率指数录得 93.99、94.36，按周分别上涨 0.11、0.32。此外，央行公布数据显示，4月外汇占款减少 420 亿元至 21.6 万亿元，连续 18 个月下降，上个月减少 546.91 亿

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-icap.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。