

市场概述 Market Overview

【每日市场动态 20171010】午后资金面大幅改善

文/ Vivian Shen

CFETS-NEX 2017/10/10

今日央行公开市场进行了 400 亿元 7 天期逆回购操作，逆回购到期 400 亿，资金零投放零回笼。Shibor 利率涨跌互现，其中隔夜品种报 2.7380%，下跌 0.20 个基点；7 天品种报 2.9390%，上涨 1.89 个基点；1 个月品种报 4.0560%，下跌 0.54 个基点；3 个月品种报 4.3541%，上涨 0.39 个基点。今日银行间市场资金面较昨日有所改善，早盘伊始，流动性延续紧势，隔夜、14 天多以高价融出，7 天鲜有卖盘，10 时左右有机构陆续融出，临近午盘不少机构的头寸需求得以满足，午后流动性继续好转，融出明显增多，尾盘更有机构减点融出隔夜。

今日发行的 1 年期、3 年期、5 年期、7 年期、10 年期国开行固息增发债中标利率分别为 3.7849%、4.2237%、4.2233%、4.3209%、4.1896%，全场倍数分别为 3.71、3.12、2.85、2.90、2.28 倍。整

体而言，今日五期国开债招标结果一般，中标收益率均低于二级市场，但长债投标倍数较低，机构需求不佳。

国债期货走势分化，尾盘涨跌不一。10 年期国债期货主力合约 T1712 收报 94.935，涨 0.03%，5 年期国债期货主力合约 TF1712 收报 97.440，跌 0.05%。今日资金面虽较昨日有所改善，但债市情绪依旧低迷，现券收益率窄幅震荡。截至目前，剩余期限 9.88 年的国开债活跃券 170215 收益率报 4.225%/4.2225%；剩余期限 9.82 年的国债活跃券 170018 收益率报 3.65%/3.6475%。

周二人民币兑美元中间价报 6.6273，较上个交易日上调 220 点，终结六连降的局面。在岸人民币兑美元高开高走，全天维持强势，截至 16:30，在岸人民币兑美元报收 6.5861，较上一交易日收盘价上涨 424 点，为 9 月 20 日以来收盘新

高；离岸人民币兑美元维持早盘强势拉升，随后继续窄幅上行，现报 6.5773，较上一交易日收盘价上涨 381 点，两岸汇差目前倒挂在 90 点附近。美元指数大幅下挫，现报 93.43，较上一交易日收盘价下跌 0.32%。

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。