



市场概述 Market Overview

【每日市场动态 20170608】进出口数据好于预期

文/ Vivian Shen

CFETS-NEX 2017/06/08

今日央行公开市场进行了 7 天 300 亿，14 天 500 亿，28 天 700 亿逆回购操作，逆回购到期 900 亿，资金净投放 600 亿。Shibor 利率全线上行，其中隔夜品种报 2.8199%，上涨 1.09 个基点；7 天品种报 2.8939%，上涨 0.20 个基点；1 个月品种报 4.5146%，上涨 8.42 个基点；3 个月品种报 4.7306%，上涨 3.18 个基点。今日银行间市场资金面较昨日有所改善，早盘隔夜均衡偏紧，临近午盘转为均衡，午后趋于宽松，而跨季资金需求旺盛，更长期限资金成交偏少。

今日发行的 3 年期、5 年期、10 年期口行增发债中标收益率分别为 4.3361%、4.3904%、4.4347%，全场倍数分别为 2.76、3.12、3.43 倍，边际倍数分别为 1.74、3.94、13.29 倍，中标收益率低于或符合市场预期。下午发行的 1 年期、5 年期国开债中标收益率分别为 3.9610%、

4.4177%，全场倍数分别为 3.10、1.81 倍，边际倍数分别为 1.65、10 倍。

国债期货早盘高开震荡上行，午后回落，尾盘收跌。10 年期国债期货主力合约 T1709 收报 94.860，跌 0.02%，5 年期国债期货主力合约 TF1709 收报 97.510，跌 0.07%。今日债市情绪谨慎，现券收益率窄幅震荡，略有上行，截至目前，剩余期限 9.84 年的国开债活跃券 170210 收益率报 4.3475%/4.345%；剩余期限 9.91 年的国债活跃券 170010 收益率报 3.66%/3.63%。

周四人民币兑美元中间价报 6.7930，下调 72 点。在岸人民币兑美元低开高走，截止 16:30，报收 6.7938，较上一交易日收盘价上涨 2 点；离岸人民币兑美元震荡走低，现报 6.7780，较上一交易日收盘价下跌 36 点，两岸汇差倒挂目前在 156 点附近。美元指数震荡波动，现报

96.77，较上一交易日收盘价上涨 0.04%。

今日海关总署公布数据显示，5 月出口同比（按美元计）增速为 8.7%，人民币值同比增速为 15.5%，5 月进口同比（按美元计）14.8%，人民币值同比增速 22.1%，均高于预期，贸易帐按美元计 408.1 亿，按人民币计 2816 亿。欧美经济的复苏带动我国出口改善，而铁矿石、原油、铜材等原材料进口量环比及同比的回升，表明内需稳定。

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。