

市场概述

Market Overview

【每日市场动态 20171106】债券市场维持窄幅震荡

文/ Ryan Rui

CFETS-NEX 2017/11/06

今日中国央行发布公告称，银行流动性总量处于较高水平，故不开展公开市场操作。今日逆回购到期 1600 亿，资金净回笼 1600 亿。Shibor 利率多数下跌，其中，隔夜品种报 2.5120%，下跌 6.52 个基点；7 天品种报 2.7970%，下跌 2.79 个基点；1 个月品种报 4.0059%，下跌 0.74 个基点；3 个月品种报 4.4294%，上涨 0.77 个基点，已连涨 20 日，创至少 9 月 11 日以来新高。月初资金大幅净回笼，银行间资金面延续上周后半周的宽松态势，早盘大行融出 1 个月以内的资金，机构需求集中在 7 天以内，午后短端资金延续宽松态势，但长端较上周五略显收敛。

今日发行的 3 年期、5 年期农发行固息增发债中标利率分别为 4.4368%、4.4852%，全场倍数分别为 3.51、3.37 倍。国债期货横盘整理，尾盘小幅拉升。

10 年期国债期货主力合约 T1712 收报 93.065，涨 0.19%，5 年期国债期货主力合约 TF1712 收报 96.170，涨 0.11%。现券收益率小幅震荡，尾盘略有下行，截至目前，剩余期限 9.80 年的国开债活跃券 170215 收益率报 4.495%/4.4875%；剩余期限 9.75 年的国债活跃券 170018 收益率报 3.8725%/3.8625%。

周五人民币兑美元中间价报 6.6247，较上个交易日下调 175 点。在岸人民币兑美元全天小幅震荡，截至 16:30，在岸人民币兑美元报收 6.6339，较上一交易日收盘价下挫 54 点；离岸人民币兑美元呈横盘整理，现报 6.6343，较上一交易日收盘价上涨 29 点，两岸汇差目前在 17 点附近。美元指数震荡偏强，现报 94.94，较上一交易日收盘价上涨 0.02%。

上周五（11 月 3 日）CFETS 人民币汇率指数录得 95.34，按周上行 0.32；参

考 BIS 货币篮子的人民币汇率指数录得 96.26，按周上行 0.30，参考 SDR 货币篮子的人民币汇率指数录得 96.07，按周上行 0.57。

中国外管局下午公布初步数据显示，第三季度经常帐户顺差 371 亿美元，资本和金融帐户逆差 371 亿美元；前三季度经常帐户顺差 1,063 亿美元，资本和金融帐户顺差 18 亿美元。总体而言，第

三季度经常账户和非储备性质的金融账户呈现双顺差，货物进出口呈现同比增长，储备资产稳健增加。

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。