市场概述

Market Overview

【每日市场动态 20170612】国债期货大幅收高

文/ Vivian Shen

CFETS-NEX 2017/06/12

今日央行公开市场进行了 7 天 100 亿，28 天 300 亿逆回购操作，逆回购到期 400 亿，资金零投放零回笼。Shibor 利率全线上行，其中隔夜品种报 2.8302%，上涨 0.27 个基点；7 天品种报 2.8968%，上涨 0.19 个基点；1 个月品种报 4.6273%，上涨 4.19 个基点；3 个月品种报 4.7763%，上涨 2.08 个基点。今日银行间市场资金面偏均衡，早盘伊始隔夜、7 天融出有限，随后有机构陆续融出，需求被迅速填平，资金面呈均衡局面，午后隔夜逐渐宽松，7 天卖盘偏少，其余期限交投清淡。

本周逆回购到期 2100 亿，MLF 到期 2070 亿，资金回笼规模较大，且根据 3 月份 MPA 考核时期资金面的波动情况，6 月中旬资金面波动加剧是大概率事件，机构将面临跨季备付、监管考核及缴税的压力，资金面仍存在不稳定性。

国债期货全天高开高走，尾盘大幅收涨。10 年期国债期货主力合约 T1709 收报 95.340，涨 0.36%，5 年期国债期货主力合约 TF1709 收报 97.810，涨 0.24%。上周末官媒纷纷表态“安抚市场”，受此影响今日国债期货大涨，带动债市情绪明显好转，现券收益率大幅走低，截至目前，剩余期限 9.83 年的国开债活跃券 170210 收益率报 4.27%/4.265%；剩余期限 9.90 年的国债活跃券 170010 收益率报 3.5825%/3.57%。

周一人民币兑美元中间价报 6.7981，上调 35 点。在岸人民币兑美元震荡走弱，截止 16:30，报收 6.7981，较上一交易日收盘价上调 7 点；离岸人民币兑美震荡走低，现报 6.7944，较上一交易日收盘价下跌 78 点，两岸汇差倒挂目前在 40 点附近。美元指数震荡下行，现报 97.12，较上一交易日收盘价下跌 0.16%。上周五

(6月9日) CFETS 人民币汇率指数录得 93.09, 按周下跌 0.07; 参考 BIS 货币篮子的人民币汇率指数录得 93.99, 按周下跌 0.07, 参考 SDR 货币篮子的人民币汇率指数录得 94.58, 按周上涨 0.18。

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。