

# 市场概述

## Market Overview

### 【每日市场动态 20171102】现券交投谨慎偏弱

文/ Ryan Rui

CFETS-NEX 2017/11/02

上月末财政集中支出推动银行体系流动性总量处于较高水平，央行今日暂停开展公开市场操作。今日逆回购到期1400亿，资金净回笼1400亿。Shibor利率多数下跌，其中隔夜品种报2.6260%，下跌11.30个基点；7天品种报2.8590%，下跌3.50个基点；1个月品种报4.0289%，下跌0.01个基点；3个月品种报4.4099%，上涨0.19个基点，已连续18日，创至少9月11日以来新高。尽管今日公开市场大幅净回笼，但银行间资金面较昨日更为宽松，早盘便有大行等机构大量融出均价隔夜资金，午后不乏减点融出；14天及以上资金多在均价附近融出，不过市场需求有限。

今早发行的3年期、5年期、10年期进出口行固息增发债中标收益率分别为4.3997%、4.4411%、4.5874%，全场倍数分别为3.81、2.96、2.80倍。下午发行

的3年期、7年期国开行固息增发债中标收益率分别为4.3893%、4.5287%，全场倍数分别为2.33、2.84倍。

国债期货早盘低开高走，午后再度回落，全线收跌。10年期国债期货主力合约T1712收报92.830，跌0.21%，5年期国债期货主力合约TF1712收报96.070，跌0.17%。当前债市交投谨慎，现券收益率维持弱势震荡，截至目前，剩余期限9.81年的国开债活跃券170215收益率报4.495%/4.485%；剩余期限9.76年的国债活跃券170018收益率报3.875%/3.8675%。目前国内经济基本面韧性较好，年末美联储大概率加息；尽管短期资金面延续宽松态势，但10月经济数据公布在即，市场交投维持谨慎。

周四人民币兑美元中间价报6.6196，较上个交易日上调104点，为逾三周来最大升幅。在岸人民币兑美元早盘走强

后回吐部分涨幅，截至 16:30，在岸人民币兑美元报收 6.6063，较上一交易日收盘价上涨 98 点；离岸人民币兑美元同样震荡走弱，涨幅收窄，现报 6.6078，较上一交易日收盘价涨 11 点，两岸汇差目前在 8 点附近。美元指数维持弱势，午后小幅拉涨，现报 94.67，较上一交易日

收盘价跌 0.14%。

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](mailto:shmarketing@cfets-nex.com.cn)

更多信息，请登录网站：[www.cfets-nex.com.cn](http://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。