

市场概述

Market Overview

【每日市场动态 20171117】债券市场平稳整理

文/ Ryan Rui

CFETS-NEX 2017/11/17

今日中国公开市场进行了 100 亿元 7 天逆回购操作、100 亿元 14 天逆回购操作、100 亿元 63 天期逆回购操作，逆回购到期 400 亿，资金净回笼 100 亿元；此外财政部进行 1200 亿国库现金定存招标，中标收益率 4.60%，较上一次招标利率上升 18 个基点，国库现金定存到期 800 亿。周五 Shibor 利率多数上涨，其中隔夜品种报 2.7380%，下跌 6.20 个基点；7 天品种报 2.8650%，下跌 2.10 个基点；1 个月品种报 4.0307%，上涨 0.37 个基点；3 个月品种报 4.6016%，上涨 3.60 个基点。今日央行公开市场小幅净回笼，不过资金面整体均衡偏松，早盘大行、股份制融出部分隔夜资金，股份制少量融出高价 7 天资金；午后隔夜资金趋于宽松，14 天跨月需求旺盛。

今早财政部发行的 91 天期贴现国债加权中标收益率为 3.7644%，边际中标收

益率为 3.8633%，全场倍数为 1.75 倍，边际倍数分别为 1.15 倍；50 年期附息国债中标收益率为 4.3700%，全场倍数为 2.23 倍，边际倍数为 1.15 倍。国债期货开盘下跌，随后弱势窄幅震荡，全线收跌。10 年期国债期货主力合约 T1803 收报 92.695，跌 0.04%，5 年期国债期货主力合约 TF1803 收报 96.340，跌 0.08%。债券市场总体维持平稳整理态势，现券收益率日内高开低走，截至目前，剩余期限 9.77 年的国开债活跃券 170215 收益率报 4.71%/4.7025%；剩余期限 9.97 年的国债活跃券 170025 收益率报 3.94%/—%。

周五人民币兑美元中间价报 6.6277，较上个交易日小幅上调 9 点。在岸人民币兑美元早盘走强后，涨幅逐渐收窄，截至 16:30，在岸人民币兑美元报收 6.6353，较上一交易日收盘价下跌 26 点；

离岸人民币兑美元由涨转跌，现报 6.6403，较上一交易日收盘价下跌 72 点，两岸汇差目前在 60 点附近。美元指数震荡回升，收复部分失地，现报 93.72，较上一交易日收盘价下跌 0.20%。

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。