

## 市场概述 Market Overview

### 【每日市场动态 20180504】国债期货尾盘大幅拉升

文/ Ryan Rui

CFETS-NEX 2018/05/04

今日央行公开市场进行 200 亿元 7 天期逆回购操作，逆回购到期 600 亿，资金净回笼 400 亿元。Shibor 利率全数下跌，其中隔夜品种报 2.5940%，下跌 8.70 个基点；7 天品种报 2.8060%，下跌 4.60 个基点；1 个月品种报 3.8510%，下跌 1.90 个基点；3 个月品种报 3.9930%，较上个交易日持平。今日银行间市场资金面延续昨日的宽松态势，早盘大行、股份制加权融出隔夜和 7 天期限资金，非银融出 14 天资金；午后隔夜资金减点融出，流动性维持充裕态势。

财政部今日发行的 91 天贴现国债加权中标收益率 2.6287%，边际收益率 2.6811%，投标倍数为 2.32 倍，边际倍数为 1.53 倍。国债期货早盘高开，随后震荡翻绿，尾盘大幅拉升，全线收红。10 年期国债期货主力合约 T1806 收报 94.770，较上个交易日上涨 0.16%；5 年

期国债期货主力合约 TF1806 收报 97.975，较上个交易日上涨 0.17%。今日资金面维持宽松态势，市场担忧今日中美经贸磋商公布的讨论结果不及预期，国债期货尾盘大幅拉升，现券收益率明显下行，截至目前，剩余期限 9.78 年的国开债活跃券 180205 收益率报 4.41%/4.3975%；剩余期限 9.75 年的国债活跃券 180004 收益率报 3.65%/3.615%。

周五人民币兑美元中间价报 6.3521，较上个交易日上调 211 点，为近 5 个交易日来首次上调。在岸人民币兑美元早盘急升，随后震荡回吐全部涨幅，午后继续走跌，截至 16:30，在岸人民币兑美元收报 6.3589，较上一个交易日下跌 56 点；离岸人民币兑美元全天早盘横盘整理，午后大幅走弱，现报 6.3606，较上一交易日下跌 166 点，两岸汇差目前在 20 点附近。美元指数早盘震荡偏弱，午

后明显走强，现报 92.58，涨 0.17%。

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。