

市场概述

Market Overview

【每日市场动态 20170928】债券市场震荡偏强

文/ Ryan Rui

CFETS-NEX 2017/09/28

今日央行公开市场进行 500 亿 14 天期、200 亿 28 天期逆回购操作，逆回购到期 700 亿，资金零投放零回笼。

Shibor 利率全线上涨，其中隔夜品种报 2.9170%，上涨 5.40 个基点；7 天品种报 2.9675%，上涨 1.81 个基点；1 个月品种报 4.0565%，上涨 3.91 个基点；3 个月品种报 4.3560%，下跌 0.05 个基点。今日资金面较昨日有所好转，早盘隔夜资金供给依旧有限，临近午盘机构融出开始增多，午后趋于均衡偏松；跨季资金全天偏紧，部分大行逐渐融出，紧势较昨日明显缓解。

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 4.2343%、4.3018%、4.3337%，投标倍数分别为 4.92、3.02、6.45 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 4.1776%、4.2943%，全场

倍数分别为 3.98、5.95 倍。整体而言，今日金融债招标结果较好，机构认购热情较好。

国债期货震荡偏强，全线收红，10 年期国债期货主力合约 T1712 收报 95.260，涨 0.13%，5 年期国债期货主力合约 TF1712 收报 97.720，涨 0.11%。今日资金面紧势有所缓解，现券收益率震荡下行，截至目前，剩余期限 9.91 年的国开债活跃券 170215 收益率报 4.19%/4.185%；剩余期限 9.85 年的国债活跃券 170018 收益率报 3.615%/3.605%。

周四人民币兑美元中间价报 6.6285，较上个交易日下调 93 点，连续第四天下调。在岸人民币兑美元全天震荡下跌，截至 16:30，在岸人民币兑美元报收 6.6699，较上一交易日收盘价下挫 349 点，为 8 月 21 日以来官方收盘新低；离岸人民币兑美元震荡下行，现报 6.6678，

较上一交易日收盘价下跌 278 点，两岸汇差目前倒挂在 18 点附近。美元指数早盘维持强势，午后大幅下挫，现报 93.40，较上一交易日收盘价下跌 0.07%。

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。