

市场概述 Market Overview

【每日市场动态 20170619】债市情绪回暖

文/ Vivian Shen



CFETS-NEX 2017/06/19

今日央行公开市场进行了 7 天 500 亿，14 天 400 亿，28 天 300 亿逆回购操作，逆回购到期 100 亿，资金净投放 1100 亿。Shibor 利率多数上行，其中隔夜品种报 2.8635%，上涨 1.07 个基点；7 天品种报 2.9204%，上涨 0.64 个基点；1 个月品种报 4.6979%，下跌 0.11 个基点；3 个月品种报 4.7470%，下跌 1.43 个基点。银行间市场资金面呈现早盘偏紧、午后转松态势，早盘大部分机构借钱，但融出极为有限；临近中午，有大行开始出钱，午后在定向降准传言的影响下，资金面由紧转松；此外，7 天至 14 天的跨月资金需求下降，但成交价高于均价。

国债期货高开高走，全线收涨。10 年期国债期货主力合约 T1709 收报 95.930，涨 0.59%，5 年期国债期货主力合约 TF1709 收报 98.235，涨 0.37%。周一央行公开市场逾千亿逆回购投放稳定年中

流动性预期，债市情绪回暖，现券收益率大幅下行，截至目前，剩余期限 9.81 年的国开债活跃券 170210 收益率报 4.1575%/4.155%；剩余期限 9.88 年的国债活跃券 170010 收益率报 3.51%/3.48%。

6 月下旬，宏观消息层面相对平静，资金面仍是左右短期债券走势的关键。本周逆回购到期 2500 亿，周一至周五分别到期 100 亿、100 亿、800 亿、1000 亿、500 亿。鉴于近期央行在公开市场以及 MLF 操作层面维稳年中流动性的迹象较为明显，本周央行大概率通过公开市场操作等方式释放维稳的积极信号以缓解市场紧张情绪。

周一人民币兑美元中间价报 6.7972，上调 23 点。在岸人民币兑美元回吐全部涨幅后，继续走弱，截止 16:30，报收 6.8170，较上一交易日收盘价下跌 31 点；离岸人民币兑美元大幅走弱，现报

6.8223, 较上一交易日收盘价下挫 80 点, 两岸汇差目前在 52 点附近。美元指数窄幅震荡, 现报 97.18, 较上一交易日收盘价上涨 0.04%。上周五 (6 月 16 日) CFETS 人民币汇率指数录得 93.24, 按周上涨 0.15; 参考 BIS 货币篮子的人民币汇率指数录得 94.22, 按周上涨 0.23, 参考 SDR 货币篮子的人民币汇率指数录得 94.76, 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。