

市场概述 Market Overview

【每日市场动态 20171110】债券市场弱势震荡

文/ Ryan Rui

CFETS-NEX 2017/11/10

今日中国央行公开市场进行 400 亿 7 天期逆回购操作、200 亿 14 天期逆回购操作、200 亿 63 天期逆回购操作，逆回购到期 300 亿，资金净投放 500 亿，为 本月以来首次净投放。Shibor 利率全线 上涨，其中隔夜品种报 2.7170%，上涨 7.10 个基点；7 天品种报 2.8455%，上涨 3.45 个基点；1 个月品种报 4.0104%，上 涨 0.70 个基点；3 个月品种连涨 24 日， 报 4.4747%，上涨 1.79 个基点。今日资 金面继续总体均衡，早盘股份制融出少 量隔夜、7 天资金，午后隔夜资金融出增 多，尾盘有减点融出；7 天资金全天需求 较大，但融出依旧有限，价格偏高。

今早财政部发行的 91 天期贴现国债 中标收益率 3.5782%，投标倍数为 2.16 倍，182 天期贴现国债中标收益率 3.6492%，投标倍数 2.1 倍。国债期货早 盘下挫，随后维持横盘整理，尾盘略有

回升，全线小幅收跌。10 年期国债期货 主力合约 T1712 收报 92.690，下跌 0.09%，5 年期国债期货主力合约 TF1712 收报 95.990，下跌 0.04%。金融数据公 布在即，债市情绪依旧谨慎，叠加资金 面逐步收敛，现券收益率持续走高，截 至目前，剩余期限 9.79 年的国开债活跃 券 170215 收益率报 4.60%/4.595%；剩 余期限 9.73 年的国债活跃券 170018 收 益率报 3.925%/3.90%。

周五人民币兑美元中间价报 6.6282， 较上个交易日上调 43 点。在岸人民币兑 美元全天维持震荡，截至 16:30，在岸人 民币兑美元报收 6.6400，较上一交易日 收盘价跌 9 点；离岸人民币兑美元早盘 震荡走强，午后 15:00 后直线走弱，回 吐全部涨幅，现报 6.6483，较上一交易 日收盘价微跌 1 点，两岸汇差目前在 80 点附近。美元指数早盘弱势整理，随后

快速拉升，现报 94.54，较上一交易日收盘价涨 0.01%。

中国财政部公布数据显示，10 月全国一般公共预算收入 16,234 亿元人民币，同比增长 5.4%。10 月全国一般公共预算支出 11,122 亿元，同比下降 8%。1-10 月累计，全国一般公共预算收入 150,363 亿元，同比增长 9.2%。1-10 月累计，全

国一般公共预算支出 162,995 亿元，同比增长 9.8%。

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。