

市场概述 Market Overview

【每日市场动态 20180306】午后国债期货大幅上涨

文/ Vivian Shen

CFETS-NEX 2018/03/06

周二央行发布公告称，目前银行体系流动性总量处于较高水平，不开展公开市场操作。今日无逆回购到期，资金零投放零回笼。Shibor 利率短端下跌、长端上涨，其中隔夜品种报 2.6170%，下跌 3.50 个基点；7 天品种报 2.8860%，下跌 0.80 个基点；1 个月品种报 4.1453%，上涨 7.27 个基点；3 个月品种报 4.7332%，上涨 1.12 个基点。今日银行间市场流动性较昨日宽松，早盘隔夜供给充足，7 天有少量融出，午后资金面更显宽松态势，隔夜融出减点幅度较大，跨季资金需求旺盛，价格居高。

今早发行的 1 年期、2 年期、3 年期国开行固息债中标利率分别为 4.0436%、4.4550%、4.62%，全场倍数分别为 2.77 倍、4.93 倍、2.57 倍，边际倍数分别为 4.33 倍、4.33 倍、3.37 倍。

国债期货早盘维持横盘震荡，午后大

涨，尾盘收红。10 年期国债期货主力合约 T1806 收报 92.990，较上个交易日上涨 0.42%，5 年期国债期货主力合约 TF1806 收报 96.550，较上个交易日上涨 0.18%。早盘债市维持盘整格局，午后受银监会拟下调商业银行贷款损失准备监管要求的消息刺激，国债期货大幅上涨，现券收益率下行。截至目前，剩余期限 9.47 年的国开债活跃券 170215 收益率报 4.90%/4.895%；剩余期限 9.67 年的国债活跃券 170025 收益率报 3.87%/—%。

周二人民币兑美元中间价报 6.3386，较上个交易日上调 45 点。在岸人民币兑美元早盘快速上涨后小幅回跌，午后急剧下跌，临近尾盘小幅回升，截至 16:30，在岸人民币兑美元收报 6.3401，较上个交易日收盘价上涨 5 点；离岸人民币兑美元早盘一路下行，午盘小幅回升，午后再度下行，现报 6.3393，较上一交易

日收盘价下跌 40 点，两岸汇差目前倒挂 9 点左右。美元指数早盘下跌，随后全天小幅震荡上行，尾盘再度下挫，现报 89.97，跌 0.03%。

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。