

市场概述

Market Overview

【每日市场动态 20180320】国债期货尾盘大幅拉升

文/ Ryan Rui

CFETS-NEX 2018/03/20

今日央行发布公告称，目前银行体系流动性总量处于较高水平，可吸收央行逆回购到期等因素的影响，不开展公开市场操作。今日逆回购到期 500 亿元，资金净回笼 500 亿元。Shibor 利率多数下跌，其中隔夜品种报 2.5580%，下跌 0.30 个基点；7 天品种报 2.8610%，下跌 0.20 个基点；1 个月品种报 4.5093%，下跌 0.28 个基点；3 个月品种报 4.6850%，下跌 1.90 个基点。今日银行间市场资金面整体均衡偏松，早盘大行、股份制行融出隔夜至 7 天期限资金，政策性银行融出隔夜至 14 天期限资金，隔夜和 7 天资金需求相对较多，上午 11 点部分机构开始融出少量减点隔夜，午后资金面总体平稳，维持均衡偏松态势。

今日发行的 1 年期、2 年期、5 年国开行固息债中标利率分别为 3.9243%、4.3693%、4.69%，全场倍数分别为 4.87

倍、5.35 倍、4.11 倍，边际倍数分别为 2.34 倍、1.06 倍、1 倍。国债期货早盘走强后横盘整理，午后小幅拉涨，尾盘大幅拉升。10 年期国债期货主力合约 T1806 收报 93.225，较上个交易日上涨 0.38%；5 年期国债期货主力合约 TF1806 收报 96.675，较上个交易日上涨 0.17%。今日资金面整体维持均衡偏松态势，国债期货大幅走强，现券收益率明显下行。截至目前，剩余期限 9.44 年的国开债活跃券 170215 收益率报 4.87%/4.8625%；剩余期限 9.63 年的国债活跃券 170025 收益率报 3.83%/3.80%。

周二人民币兑美元中间价报 6.3246，较上个交易日上调 74 点。在岸人民币兑美元早盘震荡走强，午后一路下行，截至 16:30，在岸人民币兑美元收报 6.3301，较上个交易日收盘价上涨 21 点；离岸人民币兑美元全天震荡下行，现报

6.3268，较上一交易日收盘价下挫 79 点，
两岸汇差目前倒挂 20 点附近。美元指数
全天维持弱势震荡，小幅走强，现报
89.92，跌 0.01%。

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。