

市场概述 Market Overview

【每日市场动态 20171024】债市维持震荡区间

文/ Vivian Shen

CFETS-NEX 2017/10/24

今日中国央行发布公告称，为对冲税期高峰、政府债券发行缴款和央行逆回购到期等因素的影响，故于公开市场进行了 1300 亿元 7 天期逆回购操作、1200 亿元 14 天期逆回购操作，逆回购到期 1100 亿，资金净投放 1400 亿元。Shibor 利率多数上行，其中隔夜品种报 2.6340%，上涨 1.80 个基点；7 天品种报 2.8343%，上涨 0.02 个基点；1 个月品种报 4.0186%，下跌 0.14 个基点；3 个月品种报 4.3803%，上涨 0.10 个基点。

今日银行间市场资金面边际收敛，早盘隔夜融出有限，价格小幅上行，7 天卖盘增多，跨月资金需求旺盛，临近午盘资金面趋于均衡，尾盘大行、城商行隔夜卖盘增多，资金面偏均衡偏松；长端方面，跨年融出增多。

今早发行的 1 年期、3 年期、5 年期、7 年期、10 年期国开行固息增发债中标

收益率分别为 3.8096%、4.2270%、4.2838%、4.4010%、4.2703%，全场倍数分别为 4.02、2.75、3.41、4.29、2.66 倍，边际倍数分别为 1.03、1.08、1.97、16.1、1.8 倍。

国债期货早盘横盘震荡，午后下挫，尾盘回升，小幅收跌。10 年期国债期货主力合约 T1712 收报 94.145，跌 0.01%，5 年期国债期货主力合约 TF1712 收报 96.980，跌 0.02%。今日债市交投偏谨慎，现券收益率震荡整理。截至目前，剩余期限 9.84 年的国开债活跃券 170215 收益率报 4.32%/4.315%；剩余期限 9.78 年的国开债活跃券 170018 收益率报 3.725%/3.72%。

周二人民币兑美元中间价报 6.6268，较上个交易日下调 63 点。在岸人民币兑美元早盘高开高走，午后走跌，回吐部分涨幅，尾盘再度反弹，截至 16:30，在

岸人民币兑美元报收 6.6332，较上一交易日收盘价上涨 66 点；离岸人民币兑美元与在岸人民币兑美元走势相似，现报 6.6328，较上一交易日收盘价涨 60 点，两岸汇差目前在 35 点附近。美元指数早盘震荡下行，随后一路走高，尾盘再度回落，现报 93.80，较上一交易日收盘价下挫 0.04%。

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。