

# 市场概述

## Market Overview

### 【每日市场动态 20170605】 国债期货高开高走

文/ Vivian Shen

CFETS-NEX 2017/06/05

今日央行公开市场进行了 400 亿 7 天期、300 亿 28 天期逆回购操作，暂停 14 天逆回购，逆回购到期 300 亿，单日净投放 400 亿。Shibor 利率多数上涨，其中隔夜品种报 2.8167%，上涨 2.14 个基点；7 天品种报 2.8940%，上涨 1.00 个基点；1 个月品种报 4.2830%，上涨 9.38 个基点；3 个月品种报 4.6225%，上涨 2.13 个基点。今日资金面呈紧张态势，早盘大行融出较少，隔夜、7 天供不应求，偏紧势延续至下午 15 时 30 分，随后有零星卖盘融出，资金面趋于紧平衡，跨季资金需求旺盛，但融出较少。

进入 6 月份，机构明显对年中考核，尤其是货币市场资金面心存忧虑，资金准备的时间也较往常更早。而今日央行重启跨季 28 天逆回购操作，维稳流动性意图明显，预计短期资金面维持紧平衡。

上周公布的美国非农数据不及预期以

及英国再度遭受恐怖袭击，推动避险情绪上升，今日国债期货高开高走，尾盘多数收涨。10 年期国债期货主力合约 T1709 收报 95.010，涨 0.26%，5 年期国债期货主力合约 TF1709 收报 97.785，涨 0.14%。今日债市维持震荡，现券收益率较上周五小幅下行，截至目前，剩余期限 9.85 年的国开债活跃券 170210 收益率报 4.3375%/4.335%；剩余期限 9.92 年的国债活跃券 170010 收益率报 3.615%/3.605%。

周一人民币兑美元中间价报 6.7935，上调 135 点。在岸人民币兑美元早盘先大幅走高，随后略有回落并维持横盘震荡，尾盘再度上升，截止 16:30，报收 6.8014，较上一交易日收盘价上涨 148 点；离岸人民币兑美元震荡走弱，现报 6.7810，较上一交易日收盘价下跌 104 点，两岸汇差倒挂目前在 227 点附近。

美元指数窄幅震荡，现报 96.78，较上一交易日收盘价上涨 0.13%。

上周五（6月2日）CFETS 人民币汇率指数录得 93.16，按周上涨 0.90；参考 BIS、SDR 货币篮子的人民币汇率指数录得 94.06、94.40，按周分别上涨 0.87、0.86。

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](mailto:shmarketing@cfets-nex.com.cn)

更多信息，请登录网站：[www.cfets-nex.com.cn](http://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。