

F
U
T
U
R
E
S
R
E
S
E
A
R
C
H
R
E
P
O
R
T

期货研究



瑞达期货
RUIDA FUTURES



金尝发

2017 年 11 月 6 日《每日国债期货投资观察》

品种：国债期货					
SHIBOR 0/N	2.626	-0.113	回购 FR001	2.6	-0.150
SHIBOR 1W	2.859	-0.035	回购 FR007	3.1	-0.340
SHIBOR 3M	4.4099	+0.002	回购 FR014	3.8	-0.300
一年期国债收益率		3.5791		+0.000	
三年期国债收益率		3.6911		+0.010	
五年期国债收益率		3.8772		+0.024	
七年期国债收益率		3.9147		+0.010	
十年期国债收益率		3.8718		+0.009	
五债主力 TF1712 前收		97.6900		+0.000	
十债主力 T1712 前收		95.3550		+0.055	
前交易日公开市场操作		进行 4040 亿元 MLF 操作,当日有 900 亿逆回购、2070 亿 MLF 到期,净投放 1070 亿元			
今日公开市场到期		1600 亿逆回购			
品种	CTD 券代码			Imp_IRR	
五债主力	170003. IB			3.8145	
十债主力	160017. IB			4.6048	
昨重要消息数据	<ul style="list-style-type: none">中国 10 月财新服务业 PMI 51.2, 为年内的次低水平周小川: 守住不发生系统性金融风险的底线本周央行公开市场有 6900 亿逆回购到期首单公开发行债转股专项债推迟发行, 资金来源掣肘项目推进美国 10 月非农就业人口增 26.1 万, 不及预期				
今日关注	公开市场操作				
瑞达观点	国内短期流动性继续保持紧平衡状态, 监管政策一直未落地, 市场担忧情绪仍在, 期债连续四日反弹乏力。债市调整尚未结束, 需密切关注资金面及监管政策。				

免责声明

本报告中的信息均来源于公开可获得资料，瑞达期货股份有限公司力求准确可靠，但对这些信息的准确性及完整性不做任何保证，据此投资，责任自负。本报告不构成个人投资建议，客户应考虑本报告中的任何意见或建议是否符合其特定状况。本报告版权仅为我公司所有，未经书面许可，任何机构和个人不得以任何形式翻版、复制和发布。如引用、刊发，需注明出处为瑞达期货股份有限公司研究院，且不得对本报告进行有悖原意的引用、删节和修改。

