

市场概述 Market Overview

【每日市场动态 20180302】银行间资金面紧张势缓解

文/ Ryan Rui

CFETS-NEX 2018/03/02

今日央行公开市场进行 400 亿元 7 天期、300 亿元 28 天期、200 亿元 63 天期逆回购操作，逆回购到期 1100 亿元，资金净回笼 200 亿元。Shibor 利率多数上涨，其中隔夜品种报 2.7730%，上涨 8.20 个基点；7 天品种报 2.8970%，上涨 0.10 个基点；1 个月品种报 4.0451%，上涨 0.48 个基点；3 个月品种报 4.7191%，上涨 0.37 个基点。今日早盘流动性均衡偏紧，紧张情绪在上午 10 点以后得到缓解，午盘流动性均衡偏松。具体而言，早盘隔夜需求较多，大行融出少量隔夜，股份制加点融出隔夜；10 点半以后，股份制融出 7 天资金，午盘大行加权融出 7 天，但买盘较少。

财政部今早发行的 91 天期贴现国债加权中标利率 3.1246%，边际中标利率 3.1695%，全场倍数 3.08，边际倍数 1.07。国债期货全天小幅震荡，尾盘收

跌。10 年期国债期货主力合约 T1806 收报 92.635，较上个交易日下跌 0.04%，5 年期国债期货主力合约 TF1806 收报 96.430，较上个交易日下跌 0.02%。今日资金面紧张态逐渐趋于缓解，但债市走势较为疲弱，现券收益率震荡走高。截至目前，剩余期限 9.48 年的国开债活跃券 170215 收益率报 4.9225%/4.915%；剩余期限 9.68 年的国债活跃券 170025 收益率报 3.86%/3.845%。

周五人民币兑美元中间价报 6.3334，较上个交易日上调 18 点。在岸人民币兑美元早盘快速下跌，随后震荡回升，截至 16:30，在岸人民币兑美元收报 6.3472，较上个交易日收盘价下跌 42 点；离岸人民币兑美元全天震荡走强，现报 6.3455，较上一交易日收盘价上涨 21 点。美元指数早盘走弱，午后收复部分失地，现报 90.16，下挫 0.12%。

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。