市场概述

Market Overview

【每日市场动态 20170224】资金面紧势继续缓和

文/ Vivian Shen

CFETS-ICAP 2017/02/24

今日央行公开市场进行 7 天 100 亿、14 天 100 亿、28 天 100 亿逆回购操作，逆回购到期 500 亿，资金净回笼 200 亿元。Shibor 利率涨跌互现，其中隔夜品种报 2.4756%，下跌 5.15 个基点；7 天品种报 2.7250%，上涨 0.90 个基点；1 个月品种报 4.0910%，下跌 0.20 个基点；3 个月品种报 4.2829%，下跌 0.11 个基点。今日银行间市场资金面紧势继续缓解，其中早盘隔夜资金均衡偏紧，午后逐渐宽松，7 天至 21 天资金依旧偏紧，价格较高，1 个月及以上资金融出较前几日减少。下周逆回购到期 4300 亿，到期资金规模不大，但鉴于跨月因素以及央行连续两日公开市场净回笼，资金面仍存在不确定性。

今日财政部发行的 91 天期记账式贴现国债中标收益率 2.5344%，边际中标收益率 2.5917%，全场倍数为 2.12 倍，招

标结果一般。国债期货早盘先走高后大幅回落，午后震荡上涨，尾盘再度下跌。10 年期国债期货主力合约 T1706 收报 95.655，涨 0.02%，5 年期国债期货主力合约 TF1706 收报 98.795，跌 0.03%。今日债市多空方胶着，现券收益率窄幅上行，截至目前，剩余期限 9.50 年的国开债活跃券 160213 收益率报 4.065%/4.0575%；剩余期限 9.70 年的国债活跃券 160023 收益率报 3.32%/3.30%。目前债市易受消息面冲击，短期现券走势缺乏方向性，主要跟随国债期货走势而波动，近期监管层推出各类政策，去杠杆意图明显，短期债市不可过分乐观。

周五人民币兑美元中间价报 6.8655，上调 40 点。在岸人民币兑美元早盘持续走强，午后略有回落，截止 16:30，报收 6.8718，较上一交易日收盘价涨 56 点；离岸人民币兑美元早盘先走弱后上行，

午后震荡回落，现报 6.8570，较上一交易日收盘价跌 81 点，两岸汇差继续倒挂，目前汇差倒挂在 160 点。美元指数早盘先窄幅走强后大幅下跌，午后继续下行，尾盘直线飙升，现报 101.01，涨 0.05%。

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-icap.com.cn

更多信息，请登录网站：www.cfets-icap.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。