

市场概述 Market Overview

【每日市场动态 20170721】现券收益率小幅震荡

文/ Ryan Rui

CFETS-NEX 2017/07/21

央行今日公开市场进行 1000 亿 7 天期、400 亿 14 天期逆回购操作，逆回购到期 1000 亿，资金净投放 400 亿。Shibor 利率几乎全线下跌，其中隔夜品种报 2.7330%，下跌 2.04 个基点；7 天品种报 2.8470%，下跌 0.60 个基点；1 个月品种报 3.9497%，下跌 2.95 个基点；3 个月品种报 4.2550%，下跌 0.01 个基点。周五资金面总体呈现均衡偏紧态势，早盘隔夜、7 天资金大行融出有限，流动性较为紧张，午后有股份制银行陆续融出，且买盘需求逐渐减退，资金面趋于均衡，14 天有非银高价融出，另外有不少跨月需求。本周央行公开累计净投放 5100 亿，创半年单周投放新高，随着缴税等影响减弱，流动性逐渐好转，下周资金面料趋于均衡。

今早财政部发行的 91 天期贴现国债加权中标收益率为 3.0216%，边际中标收

益率为 3.0554%，全场倍数为 2.84 倍，边际倍数为 2.5 倍。此外，发行的 30 年期附息国债中标收益率为 4.05%，全场倍数为 1.7 倍，边际倍数为 1.07 倍。

国债期货高开低走，维持弱势。10 年期国债期货主力合约 T1709 收报 95.220，跌 0.10%，5 年期国债期货主力合约 TF1709 收报 97.730，跌 0.05%。现券收益率早盘小幅下行，午后逐渐走高，截至目前，剩余期限 9.73 年的国开债活跃券 170210 收益率报 4.18%/4.178%；剩余期限 9.79 年的国债活跃券 170010 收益率报 3.585%/3.58%。

周五人民币兑美元中间价报 6.7415，较上个交易日上调 49 点。在岸人民币兑美元早盘走强回吐部分涨幅，截至 16:30，在岸人民币兑美元报收 6.7681，较上一交易日收盘价微涨 7 点；离岸人民币兑美元早盘偏强，冲高回落，现报 6.7628，

较上一交易日收盘价下跌 72 点，两岸汇率目前倒挂在 60 点附近。美元指数震荡偏弱，现报 94.17，较上一交易日收盘价跌 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。