

市场概述

Market Overview

【每日市场动态 20180315】资金面呈现宽松态势

文/ Ryan Rui

CFETS-NEX 2018/03/15

今日央行公开市场进行 200 亿元 7 天期、200 亿元 28 天期逆回购操作。今日无逆回购到期，资金净投放 400 亿元。Shibor 利率涨跌互现，其中隔夜品种报 2.6320%，下跌 0.10 个基点；7 天品种报 2.8660%，下跌 0.30 个基点；1 个月品种报 4.4908%，上涨 3.30 个基点；3 个月品种报 4.7139%，下跌 0.51 个基点。今日银行间货币市场资金面宽松，早盘隔夜和 7 天交投活跃，国开融出少量隔夜至 21 天，午后资金继续宽松，银行类隔夜减点融出。

今日发行的 1 年期、3 年期、5 年期进出口行固息增发债中标利率分别为 3.9967%、4.6297%、4.7593%，全场倍数分别为 5.98 倍、3.02 倍、2.25 倍，边际倍数分别为 1.22 倍、1 倍、1.37 倍。下午发行的 2 年期、5 年期、7 年期国开行固息增发债中标利率分别为 4.3932%、

4.7161%、4.8658%，全场倍数分别为 7.51 倍、3.85 倍、3.26 倍，边际倍数分别为 2.3 倍、1.49 倍、1.16 倍。

国债期货震荡偏强，小幅收红。10 年期国债期货主力合约 T1806 收报 92.810，较上个交易日上涨 0.12%；5 年期国债期货主力合约 TF1806 收报 96.495，较上个交易日上涨 0.06%。今日资金面呈现宽松态势，债券市场小幅走强，现券收益率略有下行。截至目前，剩余期限 9.45 年的国开债活跃券 170215 收益率报 4.92%/4.905%；剩余期限 9.89 年的国债活跃券 180004 收益率报 3.84%/—%。

周四人民币兑美元中间价报 6.3141，较上个交易日上调 64 点。在岸人民币兑美元早盘快速下跌，随后维持弱势震荡，午后大幅下行，截至 16:30，在岸人民币兑美元收报 6.3221，较上个交易日收盘价下跌 59 点；离岸人民币兑美元一路下

行，现报 6.3149，较上一交易日收盘价下跌 77 点，两岸汇差目前倒挂 40 点附近。美元指数早盘震荡偏弱，午后震荡上行，收复部分失地，现报 89.71，跌 0.06%。

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。