

市场概述

Market Overview

【每日市场动态 20170815】资金面全天偏紧

文/ Vivian Shen

CFETS-NEX 2017/08/15

今日央行续作一年期 MLF 3995 亿，但未进行公开市场逆回购操作，逆回购和 MLF 分别到期 1400 亿、2875 亿，资金净回笼（包括 MLF 到期）280 亿。Shibor 利率多数上行，其中隔夜品种报 2.7980%，上涨 2.37 个基点；7 天品种报 2.8740%，上涨 0.60 个基点；1 个月品种报 3.8480%，下跌 0.32 个基点；3 个月品种报 4.3268%，上涨 1.20 个基点。今日资金面全天偏紧，大行融出短端资金有限，非银融出价格较高，股份制银行隔夜和 7 天需求旺盛，1 个月以上交投不多。

今日央行发布金融数据显示，7 月 M2 同比 9.2%，低于预期 9.5% 和前值 9.4%，再创历史新低。7 月社融增量 12200 亿元，高于预期的 10000 亿元，但低于前值。7 月新增人民币贷款 8255 亿元，高于预期的 8000 亿元，不及前值。

今日发行的 1 年期、3 年期、10 年期

国开行固息增发债中标收益率分别为 3.5257%、4.0046%、4.2105%，全场倍数分别为 4.73、3.46、2.47 倍，边际倍数分别为 12、1.93、1.11 倍。今日招标结果一般，国开债中标收益率均高于市场预期均值，短端债券投标倍数较好。

国债期货高开低走，尾盘小幅收涨。10 年期国债期货主力合约 T1709 收报 95.070，涨 0.09%，5 年期国债期货主力合约 TF1709 收报 97.395，涨 0.01%。今日央行 MLF 投放规模不及市场预期，资金面全天呈紧张态势，现券收益率窄幅波动，截至目前，剩余期限 9.66 年的国开债活跃券 170210 收益率报 4.2675%/4.26%；剩余期限 9.97 年的国债活跃券 170018 收益率报 3.5875%/3.585%。

周二人民币兑美元中间价报 6.6689，较上个交易日下调 88 点。在岸人民币兑

美元全天走跌，截至 16:30，在岸人民币兑美元报收 6.6771，较上一交易日收盘价下跌 84 点；离岸人民币兑美元震荡走弱，现报 6.6916，较上一交易日收盘价下跌 14 点，两岸汇差目前在 133 点附近。美元指数整体走强，现报 93.64，较上一交易日收盘价涨 0.23%。

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。