

市场概述

Market Overview

【每日市场动态 20170223】资金面紧势有所缓解

文/ Vivian Shen

CFETS-ICAP 2017/02/23

今日央行公开市场进行 7 天 200 亿、14 天 200 亿、28 天 100 亿逆回购操作，逆回购到期 900 亿，资金净回笼 400 亿元。Shibor 利率继续全线上涨，其中隔夜品种报 2.5271%，上涨 4.26 个基点；7 天品种报 2.7160%，上涨 1 个基点；1 个月品种报 4.0930%，上涨 0.80 个基点；3 个月品种报 4.2840%，上涨 0.62 个基点。今日银行间市场资金面紧势有所缓解，其中早盘隔夜资金依旧偏紧，但临近午盘有大行陆续融出，午后卖盘大增，隔夜资金由紧转松，21 天及以上资金卖盘较多，但成交较少。

今日发行的 1 年期、3 年期、5 年期、10 年期口行债中标收益率分别为 3.2002%、3.80%、3.9647%、4.1305%，全场倍数分别为 4.52、2.43、2.12、4.09 倍，1 年期、10 年期口行债招标倍数超 4 倍，其余 2 期均低于 3 倍。今日

发行的 1 年期、7 年期、20 年期国开债中标收益率分别为 3.1413%、4.0585%、4.2509%，全场倍数分别为 2.528、3.685、3.795 倍，边际倍数分别为 2.935、1.421、5.867 倍，招标倍数尚可，1 年期国开债中标收益率低于市场预测区间，其余 2 期均高于市场预期。

国债期货早盘小幅下行，随后震荡攀升，午后大幅回落，尾盘勉强收红。10 年期国债期货主力合约 T1706 收报 95.610，涨 0.05%，5 年期国债期货主力合约 TF1706 收报 98.840，涨 0.05%。今日现券收益率小幅震荡，截至目前，剩余期限 9.51 年的国开债活跃券 160213 收益率报 4.06%/4.0575%；剩余期限 9.70 年的国债活跃券 160023 收益率报 3.3175%/3.3075%。

周四人民币兑美元中间价报 6.8695，上调 135 点。在岸人民币兑美元高开低

走，随后维持弱势，尾盘直线拉升后再度回落，截止 16:30，报收 6.8774，较上一交易日收盘价涨 6 点；离岸人民币兑美元一路下行，现报 6.8643，较上一交易日收盘价跌 72 点，两岸汇差继续倒挂，目前汇差倒挂在 128 点。美元指数早盘走弱，午后跌幅缩窄，震荡上行，尾盘再度回落，现报 101.29，跌 0.04%。

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。