

市场概述 Market Overview

【每日市场动态 20180312】现券收益率窄幅震荡

文/ Ryan Rui

CFETS-NEX 2018/03/12

今日央行公开市场进行 500 亿元 7 天期、400 亿元 28 天期逆回购操作。今日无逆回购到期，资金净投放 900 亿元。Shibor 利率多数上涨，其中隔夜品种报 2.5860%，上涨 1.30 个基点；7 天品种报 2.8580%，上涨 0.10 个基点；1 个月品种报 4.3707%，上涨 4.42 个基点；3 个月品种报 4.7350%，下跌 0.60 个基点。今日早盘资金面稍显紧张，股份制加点融出隔夜至 7 天资金，大行几无融出，需求难以得到满足；午后大行加权融出隔夜资金，资金面逐渐趋于宽松。

今早发行的 3 年期、5 年期农发行固息增发债中标利率分别为 4.6238%、4.7308%，全场倍数分别为 3.14 倍、2.69 倍，边际倍数分别为 10.3 倍、1.25 倍。国债期货日内窄幅震荡，全线小幅收涨。10 年期国债期货主力合约 T1806 收报 93.010，较上个交易日上涨 0.08%，

5 年期国债期货主力合约 TF1806 收报 96.605，较上个交易日上涨 0.06%。债券市场小幅波动，现券收益率变化不大，10 年期国开略有走高。截至目前，剩余期限 9.46 年的国开债活跃券 170215 收益率报 4.875%/4.8725%；剩余期限 9.66 年的国债活跃券 170025 收益率报 3.85%/3.82%。

周一人民币兑美元中间价报 6.3333，较上个交易日上调 118 点。在岸人民币兑美元早盘震荡偏弱，午后一路上行，截至 16:30，在岸人民币兑美元收报 6.3236，较上个交易日收盘价上涨 134 点；离岸人民币兑美元震荡下行，午后快速上涨，现报 6.3229，较上一交易日收盘价上涨 30 点，两岸汇差目前倒挂在 15 点附近。美元指数早盘一路下行，午间小幅回升，午后再度下行，现报 89.99，跌 0.16%。

上周五（3月9日）CFETS 人民币汇率指数录得 95.95，按周下行 0.32；参考 BIS 货币篮子的人民币汇率指数录得 98.52，按周下行 0.26，参考 SDR 货币篮子的人民币汇率指数录得 97.04，按周下行 0.29。

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。