

市场概述

Market Overview

【每日市场动态 20170208】现券收益率震荡下行

文/ Vivian Shen

CFETS-ICAP 2017/02/08

今日央行连续第四日暂停公开市场操作，逆回购到期 1250 亿，资金净回笼 1250 亿元。Shibor 利率涨跌不一，其中隔夜品种报 2.2765%，下跌 0.45 个基点；7 天品种报 2.6330%，上涨 0.47 个基点；1 个月品种报 3.9601%，上涨 2.97 个基点；3 个月品种报 4.1094%，上涨 9.34 个基点。今日银行间市场资金面总体偏松，受节前资金到期集中的影响，机构融出主要集中于短端，对长期资金的融出较为谨慎，长端资金交投清淡。明后两日共 2300 亿逆回购到期，而下周除 11350 亿的逆回购、MLF 到期外，还有大量 TLF 到期，节后资金集中回笼不可小觑。

今日财政部发行 1 年期、10 年期国债，中标利率分别为 2.7845%、3.3954%，投标倍数分别为 2.6 倍、4.08 倍，边际倍数 2.6 倍、3.22 倍。今日债券二级市场

情绪转暖，国债期货大幅上涨，带动一级招标结果向好，10 年期国债认购热情较旺盛。

国债期货高开高走，午后震荡下行，尾盘直线拉升。10 年期国债期货主力合约 T1706 收报 94.180，涨 0.57%，5 年期国债期货主力合约 TF1706 收报 97.940，涨 0.35%。今日债市情绪回暖，现券收益率震荡下行，截至目前，剩余期限 9.55 年的国开债活跃券 160213 收益率报 4.155%/4.15%；剩余期限 9.74 年的国债活跃券 160023 收益率报 3.445%/3.42%。

周三人民币兑美元中间价报 6.8849，下调 245 点。在岸人民币兑美元早盘直线下跌，随后震荡上行，午后大幅走弱，截止 16:30，报收 6.8780，较上一交易日收盘价涨 35 点；离岸人民币兑美元早盘走强，随后震荡下行，现报 6.8480，较上一交易日收盘价下挫 125 点，两岸

汇差继续倒挂，目前汇差倒挂在 377 点。
美元指数早盘小幅走弱，午后震荡上升，
现报 100.50，涨 0.10%。

今日外管局发布 2016 年四季度及全
年国际收支平衡表初步数。去年四季度，
我国经常账户顺差 2576 亿元人民币，资
本和金融账户逆差 2576 亿元人民币。

2016 年，我国经常账户顺差 13950 亿元
人民币，资本和金融账户逆差 3183 亿元
人民币。

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。