市场概述
Market Overview

【每日市场动态 20180130】资金面维持宽松态势

文/ Ryan Rui

CFETS-NEX 2018/01/30

今日央行发布公告称，考虑到金融机构有序动用“临时准备金动用安排(CRA)”和月末财政支出可吸收央行逆回购到期、现金投放等因素的影响，为维护银行体系流动性合理稳定，不开展公开操作。今日逆回购到期 2400 亿元，资金净回笼 2400 亿元。Shibor 利率涨跌互现，其中隔夜品种报 2.5540%，下跌 1.20 个基点；7 天品种报 2.8380%，下跌 0.40 个基点；1 个月品种报 4.1288%，上涨 0.12 个基点；3 个月品种报 4.7267%，下跌 0.03 个基点。今日银行间市场资金面延续前期宽松态势，早盘便有大行融出隔夜至 21 天资金，股份制融出隔夜至 14 天资金，银银间回购定盘利率多数下跌，午后流动性依旧充裕，不乏机构减点融出资金，长期限方面，大行、农商融出部分跨春节资金，不过买盘不多。

今早发行的 1 年期、2 年期、3 年期国开行固息债中标收益率分别为 4.1167%、4.5300%、4.6873%，全场倍数分别为 3.45、4.45、3.81 倍。国债期货全天维持弱势震荡，全线收绿。10 年期国债期货主力合约 T1803 收报 91.785，较上个交易日下跌 0.15%，5 年期国债期货主力合约 TF1803 收报 95.875，较上个交易日下跌 0.10%。今日资金面继续宽松，债市情绪维持谨慎，现券收益率小幅波动，变化不大。截至目前，剩余期限 9.57 年的国开债活跃券 170215 收益率报 5.0975%/5.095%；剩余期限 9.76 年的国债活跃券 170025 收益率报 3.935%/3.925%。

周二人民币兑美元中间价报 6.3312，较上个交易日下调 45 点，终止 7 日连涨。在岸人民币兑美元全天弱势震荡，尾盘跌幅明显扩大，截至 16:30，在岸人民币兑美元收报 6.3415，较上一交易日收盘

价下跌 149 点。离岸人民币兑美元同样震荡偏弱，午后跌幅扩大，现报 6.3475，较上一交易日收盘价下挫 94 点，两岸汇差目前在 55 点附近；美元指数早盘快速拉升后回调，午后震荡上行，走势偏强，现报 89.51，较上一交易日收盘价上涨 0.16%。

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。