

市场概述 Market Overview

【每日市场动态 20180222】节后首日债市走软

文/ Vivian Shen

CFETS-NEX 2018/02/22

今日央行发布公告称，为对冲税期、金融机构缴存法定存款准备金等因素的影响，维护银行体系流动性合理稳定，央行开展 1600 亿元 7 天期、1300 亿元 28 天期、600 亿元 63 天期逆回购操作。今日无逆回购到期，春节假期到期的 2435 亿元 MLF 顺延至今日到期，资金净投放 1065 亿。Shibor 利率多数下跌，其中隔夜品种报 2.6310%，下跌 9.20 个基点；7 天品种报 2.8910%，下跌 1.90 个基点；1 个月品种报 4.0666%，下跌 0.85 个基点；3 个月品种报 4.7054%，上涨 0.23 个基点。

节后首日，银行间市场资金面早盘小幅收紧，机构融出偏少，临近午盘供需趋于平衡，午后资金融出增多，流动性逐渐宽松，尾盘有机构减点融出隔夜资金，此外，7 天及以上的跨月资金需求增多。

国债期货低开低走，全天维持弱势震荡，尾盘收跌。10 年期国债期货主力合约 T1806 收报 91.70，较上个交易日下跌 0.27%，5 年期国债期货主力合约 TF1806 收报 95.880，较上个交易日下跌 0.18%。今日是春节假期后的第一个交易日，受美联储会议纪要偏鹰、美债收益率大涨的影响，现券收益率高开，随后维持低迷态势。截至目前，剩余期限 9.51 年的国开债活跃券 170215 收益率报 5.03%/5.02%；剩余期限 9.70 年的国债活跃券 170025 收益率报 3.90%/—%。

周四人民币兑美元中间价报 6.3530，较上个交易日下调 102 点。在岸人民币兑美元全天震荡下跌，截至 16:30，在岸人民币兑美元收报 6.3605，较上个交易日收盘价下跌 164 点；离岸人民币兑美元一路下行，现报 6.3497，较上一交易日收盘下跌 114 点。美元指数全天温和

震荡上行，午后涨幅扩大，临近尾盘大幅跳水，回吐全部涨幅，现报 90.05，下跌 0.06%。

上周三（2 月 14 日）CFETS 人民币汇率指数录得 96.12，按周下跌 0.80；参考 BIS 货币篮子的人民币汇率指数录得 98.56，按周下跌 0.81，参考 SDR 货币篮子的人民币汇率指数录得 97.02，按周下跌 0.66。

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。