

市场概述

Market Overview

【每日市场动态 20170307】 外汇储备终结八连跌

文/ Ryan Rui

CFETS-ICAP 2017/03/07

今日央行公开市场进行 7 天 100 亿、14 天 100 亿、28 天 100 亿逆回购操作，逆回购到期 400 亿，资金净回笼 100 亿元。此外今日 MLF 到期 1940 亿，央行续作 1940 亿，其中 6 个月 885 亿，1 年期 1055 亿，中标利率与上期持平。Shibor 利率涨跌互现，其中隔夜品种报 2.4041%，上涨 0.08 个基点；7 天品种报 2.6440%，下跌 0.20 个基点；1 个月品种报 4.1016%，上涨 0.65 个基点；3 个月品种报 4.2918%，下跌 0.07 个基点。今日银行间市场资金面早盘紧张，隔夜品种供不应求，临近午盘融出逐渐增多，资金面逐步缓解，随着央行 MLF 操作消息的释放，午后市场情绪进一步稳定，资金面也趋于宽松，大量机构减点融出隔夜。

今日发行的 1 年期、5 年期、7 年期国开行固息增发债中标收益率分别为 3.2000%、4.0239%、4.1221%，全场倍数

分别为 3.78、2.253、3.316 倍，边际倍数分别为 1.352、63 倍、1.331 倍。整体而言，1 年期、10 年期国开债中标收益率符合市场预期，5 年期中标收益率高于市场预期，投标倍数尚可。

国债期货早盘低开高走，临近午盘震荡下行，午后大幅拉升，多数收红。10 年期国债期货主力合约 T1706 收报 95.155，涨 0.18%，5 年期国债期货主力合约 TF1706 收报 98.490，涨 0.10%。今日债市交投平稳，现券收益率窄幅波动，较昨日变动不大，截至目前，剩余期限 9.47 年的国开债活跃券 160213 收益率报 4.17%/4.165%；剩余期限 9.67 年的国债活跃券 160023 收益率报 3.40%/3.385%。

周二人民币兑美元中间价报 6.8957，下调 167 点。在岸人民币兑美元开盘直线下跌，随后震荡回升，收回部分失地，截止 16:30，报收 6.8987，较上一交易

日收盘价下挫 58 点；离岸人民币兑美元震荡偏强，现报 6.8943，较上一交易日收盘价上涨 69 点，目前两岸汇差倒挂在 43 点附近。美元指数早盘震荡下行，午后略有回升，现报 101.63，跌 0.05%。

央行公布数据显示，2 月外汇储备余额 30051.2 亿美元，不但高于预期的进一步降低至 29690 亿美元，且环比增加 69.16 亿美元，为 2016 年 6 月以来首次回升，并终结了此前连续 8 个月下跌态

势。外管局称，未来跨境资金流出压力会有所缓解，外储规模可能在波动中逐步趋于稳定。

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。