

市场概述

Market Overview

【每日市场动态 20170320】资金面呈现紧张格局

文/ Ryan Rui

CFETS-ICAP 2017/03/20

央行今日进行 600 亿 7 天期、200 亿 14 天期、200 亿 28 天期逆回购操作，逆回购到期 600 亿，资金净投放 400 亿。今日 Shibor 利率多上涨，其中隔夜品种报 2.6325%，下跌 0.05 个基点；7 天品种报 2.7471%，上涨 2.21 个基点；1 个月品种报 4.3172%，上涨 3.97 个基点；3 个月品种报 4.3711%，上涨 2.04 个基点。今日银行间市场资金面整体偏紧，早盘各期限均供不应求，午后资金面紧势并未有明显缓解，成交集中在隔夜和 7 天，跨季需求较多，但价格偏高，成交有限。

今日央行重回资金净投放，本周到期资金量也不大，但净投放规模相对较小，叠加季末考核担忧，机构谨慎态度难改，资金面依然偏紧，流动性并不宽裕。

今日发行的 3 年期、7 年期、15 年期农发行固息增发债中标收益率分别为 3.9737%、4.2132%、4.3985%，投标倍数

分别为 2.49、3.67、4.47 倍。国债期货早盘跳水走低后，逐渐回升，午后震荡下行。10 年期国债期货主力合约 T1706 收报 96.365，跌 0.02%，5 年期国债期货主力合约 TF1706 收报 98.815，跌 0.07%。现券市场维持震荡，收益率略有上行，截至目前，剩余期限 9.44 年的国开债活跃券 160213 收益率报 4.12%/4.115%；剩余期限 9.90 年的国债活跃券 170004 收益率报 3.33%/3.305%。

周一人民币兑美元中间价报 6.8998，下调 125 点。在岸人民币兑美元早盘走强，午后略有回落，截止 16:30，报收 6.9043，较上一交易日收盘价上涨 42 点；离岸人民币兑美元震荡下行，现报 6.8936，较上一交易日收盘价跌 91 点，两岸汇差现倒挂在 107 点附近。美元指数一路下跌，15:30 后收复部分失地，现报 100.17，跌 0.22%。

外汇交易中心今早公布数据显示，上周五（3月17日）CFETS 人民币汇率指数报 93.32，按周下跌 0.91；参考 BIS 和 SDR 货币篮子的人民币汇率指数分别报 94.50、95.14，按周分别下跌 1.02 和 0.53。

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。