

市场概述

Market Overview

【每日市场动态 20170707】外储连续第五个月走升

文/ Ryan Rui

CFETS-NEX 2017/07/07

今日央行连续第 11 个交易日暂停公开市场操作，逆回购到期 200 亿，资金净回笼 200 亿。Shibor 利率全线下跌，其中隔夜品种报 2.5330%，下跌 1.43 个基点；7 天品种报 2.7858%，下跌 0.61 个基点；1 个月品种报 4.2150%，下跌 6.12 个基点；3 个月品种报 4.3607%，下跌 2.69 个基点。周五资金面整体均衡偏松，但较前两日有所收敛，早盘股份制银行融出隔夜资金，午后大行开始融出 7 天资金，部分股份制银行融入 7 天至 1 个月期限资金需求明显加大。

进入 7 月以来，资金面超乎预期，流动性均衡偏松，不过目前央行已连续三周资金净回笼，仅近两周便已回笼 5800 亿，随着下周大量逆回购和 MLF 到期、转债发行和企业缴税冲击，预计下周央行将适时重启公开市场操作。

今早财政部发行的 91 天期贴现国债

加权中标收益率为 3.2008%，边际中标收益率为 3.2836%，全场倍数为 2.97 倍，边际倍数分别为 119 倍。国债期货早盘小幅低开，临近午盘不断拉升，午后继续走高翻红，尾盘大幅跳水，全线收跌。10 年期国债期货主力合约 T1709 收报 95.115，跌 0.26%，5 年期国债期货主力合约 TF1709 收报 97.965，跌 0.11%。现券走势跟随国债期货窄幅波动，收益率较昨日尾盘小幅上升，截至目前，剩余期限 9.76 年的国开债活跃券 170210 收益率报 4.2025%/4.20%；剩余期限 9.83 年的国债活跃券 170010 收益率报 3.61%/3.585%。

周五人民币兑美元中间价报 6.7914，上调 39 点。在岸人民币兑美元早盘走强，午后一度回吐涨幅，随后再度走强，截至 16:30，报收 6.7995，较上一交易日收盘价上涨 42 点；离岸人民币兑美元全

天横盘整理，现报 6.8016，较上一交易日收盘价下跌 10 点，两岸汇差目前在 14 点附近。美元指数日内震荡偏强，现报 95.97，较上一交易日收盘价上涨 0.17%。

央行午后公布数据显示，6 月外汇储备 30567.9 亿美元，略低于预期的 30610 亿美元，前值为 30536 亿美元，外储环比增加 32.2 亿美元，为连续第五个月上升，创 2014 年 6 月以来最长上升周期。外管局表示，6 月份非美元货币相对美元总

体升值，资产价格小幅变动，外汇储备所投资的货币和资产之间发挥了此消彼长的分散化效应，外汇储备规模小幅微升。

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。