

市场概述

Market Overview

【每日市场动态 20170327】跨季资金呈现偏紧态势

文/ Ryan Rui

CFETS-ICAP 2017/03/27

央行连续第二日暂停公开市场操作，逆回购到期 800 亿，单日净回笼 800 亿。今日 Shibor 利率涨跌互现，其中隔夜品种报 2.4820%，下跌 12.20 个基点；7 天品种报 2.7993%，上涨 1.53 个基点；1 个月品种报 4.4296%，下跌 2.85 个基点；3 个月品种报 4.4364%，下跌 1.52 个基点。今日银行间市场资金面分化明显，隔夜品种宽松，跨季资金偏紧，融出价格维持高位。

国家统计局今早公布数据显示，1-2 月全国规模以上工业企业利润 1.02 万亿，同比增加 31.5%，增速较上年 12 月份加快 29.2 个百分点。其中，煤炭、钢铁和石油开采等行业利润增长较快，企业效益特别是国有控股企业明显改善。

今日发行的 1 年期、3 年期、5 年期、7 年期、10 年期、15 年期农发行固息增发债中标收益率分别为 3.5072%、

3.9170%、4.0420%、4.1832%、4.1014%、4.3528%，投标倍数分别为 3.47、3.37、2.96、2.25、4.16、3.53 倍，边际倍数分别为 4.17、1.6、17.1、3.89、1.16、1.84 倍。整体而言，今日发行的 6 期农发债多接近市场预期，全场倍数总体较高，投标热情尚可。

国债期货全天维持震荡，涨跌不一。10 年期国债期货主力合约 T1706 收报 97.310，跌 0.02%，5 年期国债期货主力合约 TF1706 收报 99.375，涨 0.08%。债券市场交投平稳，全天维持窄幅震荡，收益率变动不大，截至目前，剩余期限 9.42 年的国开债活跃券 160213 收益率报 4.045%/4.0425%；剩余期限 9.88 年的国债活跃券 170004 收益率报—%/3.23%。

周一人民币兑美元中间价报 6.8701，大幅上调 144 点，创逾一个月最高。在岸人民币兑美元早盘走强后横盘整理，

截止 16:30, 报收 6.8764, 较上一交易日收盘价大涨 112 点; 离岸人民币兑美元震荡走强, 现报 6.8548, 较上一交易日收盘价上涨 180 点, 两岸汇差现倒挂在 210 点附近。美元指数持续走软, 现报 99.12, 跌 0.33%, 盘中最低触及 99.04, 刷新逾四个月低位。

94.07、94.87, 按周分别下跌 0.43、0.27。

以上仅供参考, 谢谢!

外汇交易中心今早公布数据显示, 上周五 (3 月 24 日) CFETS 人民币汇率指数录得 92.91, 按周下跌 0.41; 参考 BIS、SDR 货币篮子的人民币汇率指数分别录得

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。