

# 市场概述

## Market Overview

### 【每日市场动态 20170804】现券收益率小幅上涨

文/ Vivian Shen

CFETS-NEX 2017/08/04

今日央行公开市场进行 900 亿 7 天、300 亿 14 天期逆回购操作，逆回购到期 1400 亿，资金净回笼 200 亿。Shibor 利率多数下行，其中隔夜品种报 2.7210%，下跌 8.60 个基点；7 天品种报 2.8657%，下跌 1.83 个基点；1 个月品种报 3.8828%，下跌 0.56 个基点；3 个月品种报 4.2724%，上涨 0.20 个基点。

今日资金面整体较为宽松，早盘大行、股份制及城商行均有融出短端资金，午后机构陆续融出减点隔夜。隔夜资金全天相对宽松，7 天大行均价融出，需求基本得以满足；14 天买盘偏少，以非银高价融出为主；1 个月及以上资金交投较前几日活跃，机构融出增多，买盘多为股份制银行。下周逆回购到期 7800 亿，周一至周五分别到期 3100 亿、1400 亿、1400 亿、600 亿、1300 亿，叠加 8 月同业存单到期规模环比增加 4692.8 亿，流

动性或存在一定波动，资金面取决于央行公开市场操作力度。

今早财政部发行的 91 天期贴现国债加权中标收益率为 2.9239%，边际中标收益率为 2.9740%，全场倍数为 2.4 倍。国债期货早盘震荡上行，午后冲高回落，小幅收高。10 年期国债期货主力合约 T1709 收报 94.740，涨 0.02%，5 年期国债期货主力合约 TF1709 收报 97.340，涨 0.05%。今日央行公开市场连续第二日净回笼，尽管资金面继续宽松，但债市仍未脱离盘整格局，现券收益率小幅上涨，截至目前，剩余期限 9.69 年的国开债活跃券 170210 收益率报 4.249%/4.24%；剩余期限 9.75 年的国债活跃券 170010 收益率报 3.6325%/3.62%。

周五人民币兑美元中间价报 6.7132，较上个交易日上调 79 点，至 2016 年 10 月以来最高。在岸人民币兑美元早盘直线

拉升，随后继续走强，截至 16:30，在岸人民币兑美元报收 6.7181，较上一交易日收盘价上涨 52 点；离岸人民币兑美元全天震荡走强，现报 6.7238，较上一交易日收盘价上涨 57 点，两岸汇差目前在 55 点附近。美元指数弱势震荡，现报 92.72，较上一交易日收盘价跌 0.10%。

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](mailto:shmarketing@cfets-nex.com.cn)

更多信息，请登录网站：[www.cfets-nex.com.cn](http://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。