

市场概述

Market Overview

【每日市场动态 20170321】资金面维持紧张态势

文/ Ryan Rui

CFETS-ICAP 2017/03/21

央行今日进行 500 亿 7 天期、200 亿 14 天期、100 亿 28 天期逆回购操作，逆回购到期 500 亿，资金净投放 300 亿。今日 Shibor 利率全线上涨，其中隔夜品种报 2.6477%，上涨 1.52 个基点；7 天品种报 2.7680%，上涨 2.09 个基点；1 个月品种报 4.3558%，上涨 3.86 个基点；3 个月品种报 4.3846%，上涨 1.35 个基点，均创 2015 年 4 月底以来最高。今日银行间市场资金面依旧整体偏紧，早盘各期限均供不应求，部分非银融出高价资金，各期限利率大幅上行，午后少量机构融出加权资金，但市场需求依旧难以满足，资金面紧势并未有明显缓解。

今日发行的 1 年期、3 年期、5 年期、10 年期国开行固息债中标收益率分别为 3.5774%、3.9574%、4.0405%、4.1091%，全场倍数分别为 3.23、3.24、3.26、4.33 倍，边际倍数分别为 2.63、1.01、

1.08、2.66 倍。整体而言，今日 4 期国开债中标收益率均高于市场预期，不过投标倍数尚可。

国债期货早盘弱势震荡，午后拉升翻红。10 年期国债期货主力合约 T1706 收报 96.580，涨 0.19%，5 年期国债期货主力合约 TF1706 收报 98.955，涨 0.10%。现券市场维持震荡，早盘收益率小幅走高，午后随国债期货拉升，收益率震荡下行，截至目前，剩余期限 9.44 年的国开债活跃券 160213 收益率报 4.115%/4.1125%；剩余期限 9.90 年的国债活跃券 170004 收益率报 3.32%/3.30%。

周二人民币兑美元中间价报 6.9071，下调 73 点。在岸人民币兑美元早盘走低，午后大幅飙升，截止 16:30，报收 6.8977，较上一交易日收盘价上涨 66 点；离岸人民币兑美元走势与在岸人民币兑美元相似，现报 6.8816，较上一交易日

收盘价涨 80 点，两岸汇差现倒挂在 68 点附近。美元指数早盘上行，午后大幅回落，现报 99.92，跌 0.42%。

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。