

市场概述

Market Overview

【每日市场动态 20170926】跨季资金需求旺盛

文/ Ryan Rui

CFETS-NEX 2017/09/26

今日央行公开市场进行 400 亿 14 天期、100 亿 28 天期逆回购操作，逆回购到期 1300 亿，资金净回笼 800 亿。Shibor 利率涨多跌少，其中隔夜品种报 2.8370%，上涨 7.90 个基点；7 天品种报 2.9291%，上涨 3.04 个基点；1 个月品种报 4.0062%，上涨 1.21 个基点；3 个月品种报 4.3558%，下跌 0.20 个基点。今日资金面总体维持紧平衡态势，早盘隔夜期限供需平衡稍紧，临近尾盘供给增多；7 天资金鲜有成交；14 天、21 天跨季资金市场需求旺盛，但价格偏高。

今日发行的 1 年期、5 年期、10 年期国开行固息增发债中标利率分别为 3.7843%、4.1750%、4.1553%，全场倍数分别为 2.27、3.17、2.94 倍。整体而言，今日 3 期国开债中标收益率接近市场预期，不过投标倍数一般。

国债期货弱势震荡，收盘表现不一，

10 年期国债期货主力合约 T1712 收报 95.225，跌 0.03%，5 年期国债期货主力合约 TF1712 收报 97.645，涨 0.00%。债券市场维持震荡，现券收益率略有上行，截至目前，剩余期限 9.92 年的国开债活跃券 170215 收益率报 4.21%/4.2075%；剩余期限 9.86 年的国债活跃券 170018 收益率报 3.61%/3.6125%。

周二人民币兑美元中间价报 6.6076，较上个交易日下调 131 点。在岸、离岸人民币兑美元早盘维持宽幅震荡，午后直线跳水，跌幅扩大，截至 16:30，在岸人民币兑美元报收 6.6305，较上一交易日收盘价大幅下挫 100 点；离岸人民币兑美元现报 6.6240，较上一交易日收盘价下跌 119 点，两岸汇差目前倒挂在 70 点附近。美元指数早盘小幅走弱，午后直线拉升，现报 92.84，较上一交易日收盘价涨 0.19%。

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。