

市场概述

Market Overview

【每日市场动态 20180213】资金面维持均衡态势

文/ Vivian Shen

CFETS-NEX 2018/02/13

今日央行发布公告称，考虑到春节后第一个工作日银行体系流动性将受到税期、中期借贷便利到期、临时准备金动用部分到期和法定存款准备金缴存等因素影响，人民银行加强预调微调，开展1年期MLF操作3930亿元，利率与上次一致。今日无逆回购到期，逆回购资金零投放零回笼。Shibor利率多数上涨，其中隔夜品种报2.5870%，上涨0.20个基点；7天品种报2.9280%，上涨1.00个基点；1个月品种报4.0705%，下跌0.45个基点；3个月品种报4.7006%，上涨0.46个基点。

周二银行间市场资金面整体处于均衡态势，早盘大行融出隔夜和14天跨春节资金，加权利率较昨日有所提高，随后资金面供需较显平衡，临近尾盘，流动性逐步充裕，资金利率较早盘有所回落。

国债期货早盘高开低走，随后小幅震

荡，尾盘涨跌不一。10年期国债期货主力合约T1806收报92.020，较上个交易日下跌0.03%，5年期国债期货主力合约TF1806收报96.065，较上个交易日上微涨0.03%。临近春节，债市交投清淡，现券收益率窄幅波动，截至目前，剩余期限9.53年的国开债活跃券170215收益率报4.995%/4.94%；剩余期限9.72年的国债活跃券170025收益率报3.89%/—%。

周二人民币兑美元中间价报6.3247，较上个交易日下调246点。在岸人民币兑美元早盘小幅走强，午后跳水截至16:30，在岸人民币兑美元收报6.3440，较上个交易日收盘价下跌150点；离岸人民币兑美元早盘上升，午后快速下跌，现报6.3381，较上一交易日收盘价下跌141点，两岸汇差目前倒挂在43点附近。美元指数一路下跌，现报89.83，下挫0.33%。

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。