

市场概述

Market Overview

【每日市场动态 20170427】资金面延续紧张态势

文/ Vivian Shen

CFETS-ICAP 2017/04/27

今日央行公开市场逆回购共计投放 500 亿，逆回购到期 900 亿，资金净回笼 400 亿。Shibor 利率全线上涨，其中隔夜品种报 2.7920%，上涨 3.30 个基点；7 天品种报 2.8449%，上涨 2.46 个基点；1 个月品种报 4.0161%，上涨 0.51 个基点；3 个月品种报 4.2917%，上涨 0.33 个基点。今日银行间市场资金面延续紧张态势，早盘隔夜、7 天需求旺盛，机构融出较少；下午 14 时后有机机构高价融出短端资金，资金面逐渐宽松，呈现均衡偏紧态势。

今早发行的 3 年期、5 年期进出口行固息增发债中标收益率分别为 4.0003%、4.1974%，全场倍数分别为 2.87、3.72 倍，边际倍数分别为 1.54、2.87 倍，2 期口行债中标收益率均接近市场预期。下午国开行发行的 1 年期固息增发债、5 年期绿色金融债中标收益率分别为

3.5527%、4.19%，全场倍数为 2.67、2.19 倍。

国债期货早盘高开后横盘震荡，午后先上行后直线下挫，尾盘略有回升，小幅收红。10 年期国债期货主力合约 T1706 收报 96.095，涨 0.19%，5 年期国债期货主力合约 TF1706 收报 98.405，涨 0.03%。在月末资金面紧张、高层频频发声强调防范金融风险、3 月规模以上工业企业利润数据表现良好等因素的交织下，今日现券收益率窄幅震荡，截至目前，剩余期限 9.33 年的国开债活跃券 160213 收益率报 4.255%/4.24%；剩余期限 9.79 年的国债活跃券 170004 收益率报 3.455%/—%。

周四人民币兑美元中间价报 6.8896，下调 51 点。在岸人民币兑美元早盘直线下跌随后震荡走高，午后继续上升，收回部分失地，截止 16:30，报收 6.8922，

较上一交易日收盘价跌 14 点；离岸人民币兑美元先走跌后震荡上升，现报

6.9007，较上一交易日收盘价跌 33 点，两岸汇差现在 68 点附近。美元指数早盘下行，午后震荡波动，现报 98.96，跌 0.01%。

国家统计局今日公布数据显示，1-3 月规模以上工业企业利润同比 28.3%，增速较 1-2 月份回落 3.2 个百分点，但总体处于较快增长水平，制造业回暖迹象未变，降成本仍持续发力。1-3 月增速回落主要原因包括原材料价格上涨快于产

品价格上涨，煤炭、石油和钢铁等相关行业盈利放缓等。

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。