

市场概述

Market Overview

【每日市场动态 20180402】现券收益率高开低走

文/ Vivian Shen

CFETS-NEX 2018/04/02

周一央行发布公告称，目前银行体系流动性总量处于较高水平，可吸收央行逆回购到期等因素的影响，不开展公开市场操作。今日逆回购到期 200 亿元，资金净回笼 200 亿。Shibor 利率全数下跌，其中隔夜品种报 2.6220%，下跌 6.80 个基点；7 天品种报 2.8830%，下跌 3.36 个基点；1 个月品种报 4.1879%，下跌 10.05 个基点；3 个月品种报 4.4052%，下跌 5.63 个基点。

今日早盘资金面维持均衡，大行融出少量隔夜资金，大行、股份制银行融出少量加权 7 天，14 天买盘以非银为主，21 天及以上期限需求不旺盛，午盘股份制、部分大行陆续融入隔夜资金，流动性有所收敛，下午 15 时后有所缓和，股份制银行减点融出隔夜。

今日发行的 3 年期、5 年期农发行固息增发债中标利率分别为 4.4021%、

4.5214%，全场倍数分别为 2.55 倍、2.89 倍，边际倍数分别为 24.64 倍、2.13 倍。国债期货早盘大幅低开，午后震荡上行，尾盘仍小幅收跌。10 年期国债期货主力合约 T1806 收报 93.650，较上个交易日下跌 0.09%；5 年期国债期货主力合约 TF1806 收报 96.910，较上个交易日下跌 0.06%。今日资金面总体维持均衡态势，官方制造业 PMI 和财新制造业 PMI 走势相背，现券收益率高开低走，截至目前，剩余期限 9.40 年的国开债活跃券 170215 收益率报 4.715%/4.705%；剩余期限 9.60 年的国债活跃券 170025 收益率报 3.77%/3.76%。

周一人民币兑美元中间价报 6.2764，较上个交易日上调 117 点。在岸人民币兑美元早盘大幅高开，随后一路下行，截至 16:30，在岸人民币兑美元收报 6.2803，较上个交易日收盘价下跌 70 点；

离岸人民币兑美元早盘高开，随后大幅跳水，现报 6.2682，较上一交易日收盘价下跌 53 点，两岸汇差目前倒挂 137 点左右。美元指数早盘震荡上涨，午后一路下行，现报 89.90，下跌 0.09%。

上周五（3 月 30 日）CFETS 人民币汇率指数录得 96.73，按周上行 0.62；参考 BIS 货币篮子的人民币汇率指数录得 99.31，按周上行 0.69，参考 SDR 货币篮子的人民币汇率指数录得 97.79，按周上行 0.85。

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。