

市场概述 Market Overview

【每日市场动态 20171023】资金面较上周五收敛

文/ Vivian Shen

CFETS-NEX 2017/10/23

今日中国央行发布公告称，为对冲税期高峰、政府债券发行缴款和央行逆回购到期等因素的影响，故于公开市场进行 1100 亿 7 天期逆回购操作、900 亿 14 天期逆回购操作，逆回购到期 600 亿，资金净投放 1400 亿。Shibor 利率涨跌互现，其中隔夜品种报 2.6160%，上涨 3.78 个基点；7 天品种报 2.8341%，下跌 0.38 个基点；1 个月品种报 4.0200%，下跌 0.35 个基点；3 个月品种报 4.3793%，上涨 0.35 个基点。今日银行间市场资金面较上周五收敛，早盘至 10 时，隔夜较为紧张，之后随着大行融出 14 天以内资金，流动性趋于均衡，午后资金面维持均衡格局，长端方面，需求偏少。

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 4.2996%、4.3749%，全场倍数分别为 2.87、3.58 倍，边际倍数分别为 1.78、43.4 倍。国

债期货早盘低开低走，午后小幅回升。

10 年期国债期货主力合约 T1712 收报 94.160，涨 0.01%，5 年期国债期货主力合约 TF1712 收报 97.020，较上周五持平。今日现券收益率早盘上行，午后随着国债期货拉涨而小幅下行。截至目前，剩余期限 9.84 年的国开债活跃券 170215 收益率报 4.3125%/4.3075%；剩余期限 9.79 年的国债活跃券 170018 收益率报 3.735%/3.72%。

周一人民币兑美元中间价报 6.6205，较上个交易日下调 113 点，降幅为 10 月 9 日来最大。在岸人民币兑美元早盘直线跳水，随后小幅回升，午后再度下挫，截至 16:30，在岸人民币兑美元报收 6.6398，较上一交易日收盘价下跌 198 点；离岸人民币兑美元维持弱势，现报 6.6426，较上一交易日收盘价跌 187 点，两岸汇差目前在 65 点附近。美元指数早

盘维持震荡下挫，午后小幅拉升，现报 93.93，较上一交易日收盘价上涨 0.25%。

上周五（10月20日）CFETS 人民币汇率指数录得 94.64，按周下行 0.36；参考 BIS 货币篮子的人民币汇率指数录得 95.51，按周下行 0.35，参考 SDR 货币篮子的人民币汇率指数录得 95.31，按周下行 0.27。

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。