

市场概述

Market Overview

【每日市场动态 20170821】资金面紧势不改

文/ Vivian Shen

CFETS-NEX 2017/08/21

今日央行公开市场进行 1000 亿 7 天期、800 亿 14 天期逆回购，逆回购到期 2300 亿，资金净回笼 500 亿。Shibor 利率全线上行，其中隔夜品种报 2.8482%，上涨 1.27 个基点；7 天品种报 2.8970%，上涨 0.30 个基点；1 个月品种报 3.8671%，上涨 0.27 个基点；3 个月品种报 4.3464%，上涨 0.24 个基点。今日银行间市场资金面全天偏紧，早盘大行融出有限，股份制银行隔夜、7 天需求旺盛，午后延续紧势；长期限交投清淡，需求较少。

今日发行的 3 年期、5 年期农发行固息债中标收益率分别为 4.1200%、4.2100%，全场倍数分别为 4.09、4.46 倍，边际倍数分别为 1.72、9.29 倍。今日全场倍数较高，机构投标热情旺盛。国债期货低开低走，尾盘收跌。10 年期国债期货主力合约 T1709 收报 94.850，

跌 0.15%，5 年期国债期货主力合约 TF1709 收报 97.245，跌 0.09%。今日资金面偏紧、叠加市场对严监管忧虑再度显现，债市交投谨慎，现券收益率震荡上行，截至目前，剩余期限 9.64 年的国开债活跃券 170210 收益率报 4.3025%/4.30%；剩余期限 9.96 年的国债活跃券 170018 收益率报 3.62%/3.61%。

周一人民币兑美元中间价报 6.6709，较上个交易日下调 35 点。在岸人民币兑美元全天维持强势，截至 16:30，在岸人民币兑美元报收 6.6702，较上一交易日收盘价上涨 83 点；离岸人民币兑美元高开低走，回吐全部涨幅，现报 6.6825，较上一交易日收盘价下跌 8 点，两岸汇差目前在 89 点附近。美元指数整体走强，现报 93.55，较上一交易日收盘价涨 0.12%。

上周五（8 月 18 日）CFETS 人民币汇

率指数录得 93.82，按周下跌 0.21；参考 BIS 货币篮子的人民币汇率指数录得 94.60，按周下跌 0.17，参考 SDR 货币篮子的人民币汇率指数录得 94.68，按周上涨 0.02。

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。