

市场概述 Market Overview

【每日市场动态 20171123】人民币兑美元大幅收涨

文/ Ryan Rui

CFETS-NEX 2017/11/23

今日中国央行公开市场进行 1400 亿 7 天期逆回购操作、1200 亿 14 天期逆回购操作、100 亿 63 天期逆回购操作，逆回购到期 1700 亿，资金净投放 1000 亿。此外，今日有 800 亿中央国库现金定存到期。Shibor 利率多数上涨，其中隔夜品种报 2.8030%，下跌 0.60 个基点；7 天品种报 2.8710%，上涨 0.30 个基点；1 个月品种报 4.0388%，上涨 0.12 个基点；3 个月品种报 4.6518%，上涨 1.43 个基点，已连涨 33 日，创 6 月 26 日以来新高。今日资金面较昨日稍有缓解，早盘股份制融出少量隔夜资金，大行、股份制等机构融入需求旺盛，股份制，城商和非银借 7 天及以上期限，资金面呈现偏紧态势；午后资金面紧张情绪得到缓解，大行等机构隔夜资金融出增多，尾盘隔夜资金完全宽松。

国债期货早盘高位横盘整理，午后大

幅跳水全线收跌。10 年期国债期货主力合约 T1803 收报 92.105，较上个交易日下挫 0.02%，5 年期国债期货主力合约 TF1803 收报 96.000，下跌 0.02%。今日资金面早盘延续紧势，午后紧势缓解，原定于今日招标的 3 期进出口行债推迟发行，现券收益率日内维持宽幅震荡，截至目前，剩余期限 9.76 年的国开债活跃券 170215 收益率报 4.93%/4.925%；剩余期限 9.70 年的国债活跃券 170018 收益率报 4.005%/—%。

周四人民币兑美元中间价报 6.6021，为 10 月 18 日以来最高，较上个交易日上调 269 点，创 10 月 11 日来最大升幅。在岸人民币兑美元早盘大幅拉涨，随后维持窄幅震荡，午后小幅回落，回吐部分涨幅，临近尾盘再度上涨，截至 16:30，在岸人民币兑美元报收 6.5823，较上一交易日收盘价大幅上涨 336 点，为 9 月

下旬以来新高；离岸人民币兑美元早盘亦大幅拉升，随后维持震荡，午后涨幅扩大，现报 6.5842，较上一交易日收盘价上涨 131 点，两岸汇差维持倒挂，目前倒挂 30 点左右。美元指数全天震荡偏弱，现报 93.19，较上一交易日收盘价下跌 0.06%。

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。