

市场概述 Market Overview

【每日市场动态 20180108】午后资金面稍有收敛

文/ Ryan Rui

CFETS-NEX 2018/01/08

今日中国央行发布公告称，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，故不开展公开市场操作。今日逆回购到期 400 亿元，资金净回笼 400 亿元。Shibor 利率全数下跌，其中隔夜品种报 2.4610%，下跌 2.30 个基点；7 天品种报 2.7370%，下跌 0.80 个基点；1 个月品种报 4.2886%，下跌 8.70 个基点；3 个月品种报 4.6594%，下跌 0.43 个基点。今日资金面整体宽松，早盘大行融出隔夜至 1 个月期限资金，股份制融出隔夜至 7 天期限资金，午后市场隔夜资金融入需求大幅增加，资金面稍有收敛。

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 4.6823%、4.8349%，全场倍数分别为 3.23 倍、2.85 倍，边际倍数分别为 2.32、1.02 倍。国债期货早盘探底回升，午后涨幅扩大，

全线收涨。10 年期国债期货主力合约 T1803 收报 92.655，较上个交易日上涨 0.19%，5 年期国债期货主力合约 TF1803 收报 96.400，较上个交易日上涨 0.15%。今日国债期货大幅上涨，但债市走势平稳，现券收益率小幅震荡，变动不大。截至目前，剩余期限 9.63 年的国开债活跃券 170215 收益率报 4.93%/4.925%；剩余期限 9.82 年的国债活跃券 170025 收益率报 3.92%/3.90%。

周一人民币兑美元中间价报 6.4832，较上个交易日上调 83 点。在岸人民币兑美元早盘震荡后横盘整理，午后大幅下跌，截至 16:30，在岸人民币兑美元报 6.4956，较上一交易日收盘价下跌 105 点，离岸人民币兑美元持续走弱，现报 6.4994，较上一交易日收盘价下挫 202 点，两岸汇差维持 30 点左右；美元指数走势强势，现报 92.28，较上一交易日收

盘价上涨 0.27%。

上周五（1月5日）CFETS 人民币汇率指数录得 94.90，按周上行 0.05；参考 BIS 货币篮子的人民币汇率指数录得 95.89，按周下行 0.04，参考 SDR 货币篮子的人民币汇率指数录得 96.17，按周上行 0.18。

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。