

市场概述 Market Overview

【每日市场动态 20171226】现券收益率震荡上行

文/ Vivian Shen

CFETS-NEX 2017/12/26

今日中国央行发布公告称，由于临近年末财政支出力度加大，对冲央行逆回购到期等因素的影响仍将继续推高银行体系流动性总量，故暂停公开市场操作。今日逆回购到期 500 亿元，资金净回笼 500 亿元。Shibor 利率多数上涨，其中隔夜品种报 2.5890%，上涨 2.00 个基点；7 天品种报 2.8920%，上涨 1.10 个基点；1 个月品种报 4.9277%，上涨 1.15 个基点；3 个月品种报 4.9090%，下跌 0.02 个基点。

今日银行间市场资金面整体均衡稍偏紧，与昨日相比略有收敛，早盘隔夜资金延续宽松态势，但午盘伊始便出现收紧迹象，大行融入需求增加，机构交投活跃，7 天跨年资金全天供不应求，主要以非银高价融出为主，价格较昨日继续上行。

国债期货早盘弱势震荡，午后小幅冲

高后回落，尾盘收跌。10 年期国债期货主力合约 T1803 收报 92.940，较上个交易日下跌 0.16%，5 年期国债期货主力合约 TF1803 收报 96.470，较上个交易日下跌 0.09%。今日资金面稍有收敛，跨年资金利率大幅飙升，叠加监管利空因素仍未出尽，现券收益率震荡上行，截至目前，剩余期限 9.67 年的国开债活跃券 170215 收益率报 4.87%/4.85%；剩余期限 9.61 年的国债活跃券 170018 收益率报 3.93%/3.885%。

周二人民币兑美元中间价报 6.5416，较上一交易日上调 267 点。在岸人民币兑美元早盘小幅走强，随后大幅下挫，午后震荡回升，收复部分失地，截至 16:30，在岸人民币兑美元报 6.5440，较上一交易日收盘价下跌 36 点；离岸人民币兑美元早盘冲高后回落，午后温和上升，现报 6.5438，较上一交易日收盘价

上涨 81 点，两岸汇差目前在 3 点左右。

美元指数早盘快速上升，随后震荡下行，

现报 93.25，较上一交易日收盘价上涨

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。