

市场概述 Market Overview

【每日市场动态 20171201】月初流动性充裕

文/ Vivian Shen

CFETS-NEX 2017/12/01

央行公告称，由于11月末财政支出力度较大，对冲央行逆回购到期等因素后银行体系流动性总量处于较高水平，故12月1日不展开公开市场操作，此外今日逆回购到期400亿，资金净回笼400亿元。Shibor 利率短端下行、长端上行，其中隔夜品种报2.6420%，下跌14.60个基点；7天品种报2.8510%，下跌4.70个基点；1个月品种报3.8760%，下跌0.80个基点；3个月品种报4.7639%，上涨0.45个基点。今日银行间市场流动性十分充裕，早盘便有减点隔夜陆续融出，7天多以加权价格成交，午后资金面继续宽松，尾盘仍有股份制的融出意愿未得以满足，更长期限方面，跨年资金价格有所下降。

今日财新公布数据显示，中国11月财新制造业PMI为50.8，低于预期的50.9和10月份的51，该数值虽然仍高

于50的临界值，但已降至5个月以来最低。这一趋势与统计局公布的官方制造业PMI存在背离。

今早财政部发行的91天期贴现国债加权收益率为3.9263%，边际收益率为3.9860%，全场倍数为2.31倍。国债期货早盘先低开，随后冲高回落，午后继续下探，临近尾盘小幅反弹，但仍微跌。10年期国债期货主力合约T1803收报92.98，较上个交易日下跌0.02%，5年期国债期货主力合约TF1803收报96.545，下跌0.01%。今日为12月的首个工作日，银行间市场流动性十分充裕，叠加11月财新制造业PMI逊于预期和前值，现券收益率下行，截至目前，剩余期限9.73年的国开债活跃券170215收益率报4.8025%/4.80%；剩余期限9.68年的国债活跃券170018收益率报3.925%/3.885%。

周五人民币兑美元中间价报 6.6067，较上个交易日下调 33 点。在岸人民币兑美元早盘震荡走弱，午后一路走高，收回全部失地，截至 16:30，在岸人民币兑美元报，6.6065，较上一交易日收盘价上涨 42 点；离岸人民币兑美元早盘弱势震荡，午后大幅上涨，现报 6.6088，较上一交易日收盘价上涨 29 点，两岸汇差收窄，目前维持在 18 点左右。美元指数全天震荡偏弱，现报 92.85，较上一交易日收盘价上涨 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。