

市场概述 Market Overview

【每日市场动态 20171229】祝大家元旦快乐！

文/ Vivian Shen

CFETS-NEX 2017/12/29

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 2.8400%，上涨 16.80 个基点；7 天品种报 2.9540%，上涨 2.90 个基点；1 个月品种报 4.9352%，上涨 0.32 个基点；3 个月品种报 4.9133%，下跌 0.01 个基点。今日银行间市场资金面早盘紧张，非银高价融出，隔夜、7 天利率高企，午后机构融出增多，流动性紧势好转，资金价格不断下行。

今早财政部发行的 91 天期贴现国债加权利率 3.7628%，边际利率 3.8879%，全场倍数 2.52，边际倍数 1.08。国债期货早盘低开低走，随后维持横盘震荡，午后反弹，尾盘小幅收涨。10 年期国债

期货主力合约 T1803 收报 93.165，较上一个交易日上涨 0.04%，5 年期国债期货主力合约 TF1803 收报 96.605，较上一个交易日上涨 0.06%。今日为 2017 年的最后一个工作日，债市交投极为清淡，午间受央行建立“临时准备金动用安排”消息的提振，现券收益率震荡下行。截至目前，剩余期限 9.66 年的国开债活跃券 170215 收益率报 4.82%/4.805%。

周五人民币兑美元中间价报 6.5342，较上一交易日上调 70 点。在岸、离岸人民币兑美元均一路上涨，截至 16:30，在岸人民币兑美元报 6.5120，较上一交易日收盘价上涨 228 点，离岸人民币兑美元现报 6.5206，较上一交易日收盘价上涨 103 点，两岸汇差目前在 87 点左右；美元指数一路下跌，现报 92.43，较上一交易日收盘价下跌 0.23%。

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。