

市场概述

Market Overview

【每日市场动态 20180105】央行连续十日暂停 OMO

文/ Ryan Rui

CFETS-NEX 2017/01/05

今日央行发布公告称，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。今日银行间市场无逆回购到期，资金零投放零回笼。Shibor 利率全线下跌，其中隔夜品种报 2.4840%，下跌 2.10 个基点；7 天品种报 2.7450%，下跌 1.50 个基点；1 个月品种报 4.3756%，下跌 10.04 个基点；3 个月品种报 4.6637%，下跌 2.33 个基点。央行已连续 10 个交易日暂停公开市场操作，资金面维持宽松态势，今日早盘大行、股份制融出隔夜至 21 天资金，股份制融入少量减点隔夜资金，14 天等月内资金市场需求有限，长期限方面，农商和非银融出跨春节资金，但与融入价格有较大偏差。

今早财政部发行的 91 天期贴现国债加权中标收益率为 3.2966%，边际中标收

益率为 3.3733%，全场倍数为 3.45 倍。此外发行的 1 年期、3 年期、5 年期进出口行固息债中标收益率分别为 4.2000%、4.6898%、4.8566%，全场倍数分别为 3.72 倍、2.66 倍、2.79 倍。

国债期货小幅震荡，基本收平。10 年期国债期货主力合约 T1803 收报 92.450，较上个交易日下跌 0.02%，5 年期国债期货主力合约 TF1803 收报 96.260，较上个交易日上涨 0.04%。今日资金面维持宽松态势，随着监管消息逐渐被消化，债市情绪有所缓和，现券收益率跟随国债期货小幅震荡，略有下行。截至目前，剩余期限 9.64 年的国开债活跃券 170215 收益率报 4.92%/4.91%；剩余期限 9.83 年的国债活跃券 170025 收益率报 3.92%/—%。

周五人民币兑美元中间价报 6.4915，较上个交易日上调 128 点。在岸、离岸

人民币兑美元走势相似，早盘震荡走强，午后回吐部分涨幅，截至 16:30，在岸人民币兑美元报 6.4851，较上一交易日收盘价上涨 117 点，离岸人民币兑美元现报 6.4826，较上一交易日收盘价上涨 91 点，两岸汇差维持倒挂，目前倒挂 40 点左右；美元指数早盘横盘整理，午后震荡走强，现报 92.01，较上一交易日收盘

价上涨 0.15%。

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。