

市场概述 Market Overview

【每日市场动态 20171211】资金面较上周收敛

文/ Vivian Shen

CFETS-NEX 2017/12/11

今日中国央行公开市场进行了 400 亿 7 天期、400 亿 28 天期逆回购操作，逆回购到期 600 亿，资金净投放 200 亿。Shibor 利率全线上涨，其中隔夜品种报 2.6880%，上涨 8 个基点；7 天品种报 2.8180%，上涨 1.90 个基点；1 个月品种报 4.4574%，上涨 2.39 个基点；3 个月品种报 4.7992%，上涨 0.74 个基点，创两年半来高位。今日银行间市场流动性较上周有所收敛，早盘机构融出有限，买盘需求旺盛，午后 15 时左右隔夜融出增多，资金面逐渐宽松，其他期限方面，21 天期跨年资金鲜有融出，长期限资金利率偏高。

国债期货早盘低开低走，午后小幅反弹后震荡回落，尾盘收跌。10 年期国债期货主力合约 T1803 收报 92.48，较上个交易日下跌 0.25%，5 年期国债期货主力合约 TF1803 收报 96.20，下跌 0.16%。

今日资金面较上周有所收敛，早盘现券收益率震荡上行，午后有消息称中国监管部门考虑延长金融机构资管业务新规过渡期至 2020 年，债市情绪短暂回暖，随后依旧回落。截至目前，剩余期限 9.71 年的国开债活跃券 170215 收益率报 4.855%/4.8275%；剩余期限 9.65 年的国债活跃券 170018 收益率报 3.96%/3.93%。

周一人民币兑美元中间价报 6.6152，较上个交易日上调 66 点，结束十连降。在岸人民币兑美元维持高位，截至 16:30，在岸人民币兑美元报 6.6173，较上一交易日收盘价涨 2 点；离岸人民币兑美元早盘大幅拉升，午后小幅回落，较上一交易日收盘价上涨 26 点，两岸汇差目前维持在 37 点左右。美元指数全天震荡下挫，现报 93.80，较上一交易日收盘价下跌 0.08%。

上周五（12 月 8 日）CFETS 人民币汇

率指数录得 94.59，按周上行 0.21；参考 BIS 货币篮子的人民币汇率指数录得 95.51，按周上行 0.27，参考 SDR 货币篮子的人民币汇率指数录得 95.20，按周上行 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。