

市场概述

Market Overview

【每日市场动态 20171219】现券收益率小幅上行

文/ Vivian Shen

CFETS-NEX 2017/12/19

今日中国央行公开市场进行了 500 亿 7 天期、300 亿 14 天期、200 亿 28 天期逆回购操作，逆回购到期 800 亿元，资金净投放 200 亿元。Shibor 利率全线上涨，其中隔夜品种报 2.7410%，上涨 1.80 个基点；7 天品种报 2.8730%，上涨 0.20 个基点；1 个月品种报 4.6869%，上涨 4.87 个基点；3 个月品种报 4.8385%，上涨 0.37 个基点。

今日早盘银行间市场流动性均衡偏紧，大行融出少量隔夜至 14 天资金，隔夜买盘需求旺盛，10 时以后流动性有所缓和，有大行、股份制融出 7 天以内资金，14 时以后资金面较为宽松，股份制陆续融出隔夜，临近尾盘有减点隔夜卖盘出现，其他期限方面，14 天跨年资金需求旺盛，1 个月期限少量成交，但价格偏高。

国债期货早盘先跌后涨，午后涨幅扩大，临近尾盘再度回落，尾盘收跌。10

年期国债期货主力合约 T1803 收报 92.820，较上个交易日下跌 0.02%，5 年期国债期货主力合约 TF1803 收报 96.395，较上个交易日下跌 0.01%。今日银行间市场流动性均衡偏紧，临近年末，市场交投意愿减弱，现券收益率全天小幅上行。截至目前，剩余期限 9.68 年的国开债活跃券 170215 收益率报 4.825%/4.8125%；剩余期限 9.63 年的国债活跃券 170018 收益率报 --%/3.90%。

周二人民币兑美元中间价报 6.6098，较上个交易日上调 64 点。在岸人民币兑美元早盘高开后先下跌后上涨，随后维持横盘震荡，尾盘大幅拉涨，截至 16:30，在岸人民币兑美元报 6.6075，较上一交易日收盘价上涨 95 点；离岸人民币兑美元早盘走弱后维持震荡，尾盘大幅反弹，现报 6.6028，较上一交易日收盘价上涨 74 点，两岸汇差目前倒挂在 47 点左右。

美元指数一路走低，现报 93.51，较上一交易日收盘价下跌 0.20%。

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。