

市场概述 Market Overview

【每日市场动态 20170912】人民币中间价终结连涨

文/ Ryan Rui

CFETS-NEX 2017/09/12

今日央行未进行逆回购操作，亦无逆回购到期。Shibor 利率短端上涨，长端下跌，其中隔夜品种报 2.6483%，上涨 0.43 个基点；7 天品种报 2.8036%，上涨 0.22 个基点；1 个月品种报 3.9354%，上涨 0.15 个基点；3 个月品种报 4.3768%，下跌 2.66 个基点。今日资金面早盘依旧维持收敛态势，7 天以内机构需求较多，午后大行融出增多，资金面逐渐均衡偏松，总体而言，近两日机构轧平头寸压力不大。

今日发行的 5 年期、7 年期、10 年期国开行固息增发债中标收益率分别为 4.2134%、4.3369%、4.2199%，全场倍数分别为 5.38、3.72、2.89 倍，边际倍数分别为 1.75、2.07、3.13 倍。总体而言，今日 3 期国开债招标结果较好，中标收益率低于市场预期，机构需求较好，短端好于长端。

国债期货早盘低位震荡，午后直线拉升，尾盘小幅跳水。10 年期国债期货主力合约 T1712 收报 95.130，涨 0.06%，5 年期国债期货主力合约 TF1712 收报 97.655，涨 0.02%。早盘现券收益率弱勢震荡，午后随国债期货走强而有所下行，尾盘继续窄幅波动，截至目前，剩余期限 9.58 年的国开债活跃券 170210 收益率报 4.335%/4.334%；剩余期限 9.91 年的国债活跃券 170018 收益率报 3.6125%/3.6075%。

周二人民币兑美元中间价报 6.5277，较上个交易日大幅下调 280 点，创今年 1 月 9 日以来最大下调幅度，终结十一日连涨。在岸人民币兑美元大幅走弱，午后跌幅收窄，截至 16:30，在岸人民币兑美元报收 6.5350，较上一交易日收盘价跌 111 点；离岸人民币兑美元一度跌破 6.55 关口，午后收复部分失地，现报

6.5414, 较上一交易日收盘价下挫 25 点,
两岸汇差目前在 80 点附近。美元指数现
报 91.80, 较上一交易日收盘价跌 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。