

市场概述 Market Overview

【每日市场动态 20180119】人民币刷新逾两年新高

文/ Ryan Rui

CFETS-NEX 2018/01/19

今日央行公开市场进行 1300 亿元 7 天期、900 亿元 14 天期、100 亿元 63 天期逆回购操作，逆回购到期 1500 亿元，资金净投放 800 亿元。Shibor 利率全线上涨，其中隔夜品种报 2.8360%，上涨 7.05 个基点；7 天品种报 2.8910%，上涨 1.30 个基点；1 个月品种报 4.1113%，上涨 1.92 个基点；3 个月品种报 4.7115%，上涨 0.71 个基点。今日早盘流动性均衡偏紧，大行融出隔夜至 7 天资金，同时融入隔夜，股份制融入隔夜至 1 个月资金，午盘流动性趋于宽松，股份制融出隔夜资金，政策性银行尾盘融入少量减点隔夜资金。

今日财政部发行的 91 天期贴息国债加权中标收益率为 3.3354%，边际中标收益率为 3.3978%，全场倍数为 2.87 倍，边际倍数为 1.04 倍。国债期货早盘低开，随后冲高回落，全线继续收跌。10 年期

国债期货主力合约 T1803 收报 91.505，较上个交易日下跌 0.03%，5 年期国债期货主力合约 TF1803 收报 95.635，较上个交易日下跌 0.06%。今日 10 年美债收益率涨破 2.64%，国内债券市场也维持弱势调整，现券收益率震荡走高。截至目前，剩余期限 9.60 年的国开债活跃券 170215 收益率报 5.125%/5.1175%；剩余期限 9.79 年的国债活跃券 170025 收益率报 3.975%/3.97%。

周五人民币兑美元中间价报 6.4169，较上个交易日上涨 232 点。在岸人民币兑美元早盘快速上涨，午后小幅回落，回吐部分涨幅，截至 16:30，在岸人民币兑美元报 6.4040，为 2015 年 12 月 4 日以来新高，较上一交易日收盘价上涨 215 点。离岸人民币兑美元全天震荡走强，午后温和回落，现报 6.3982，较上一交易日收盘价上涨 237 点，两岸汇差目前

倒挂在 10 点附近；美元指数延续前一交易日的温和震荡态势，全天小幅下行，现报 90.21，较上一交易日收盘价下挫 0.34%。

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。