市场概述
Market Overview

【每日市场动态 20180126】美元指数跌破 89 关口

文/ Ryan Rui

CFETS-NEX 2018/01/26

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，不开展公开市场操作。今日逆回购到期 2700 亿元，公开市场操作资金净回笼 2700 亿元。本周央行在公开市场逆回购净回笼资金 3200 亿元，MLF 净回笼 1070 亿元。Shibor 利率多数下跌，其中隔夜品种报 2.5506%，下跌 1.28 个基点；7 天品种报 2.8420%，下跌 0.78 个基点；1 个月品种报 4.1257%，下跌 0.12 个基点；3 个月品种报 4.7292%，下跌 0.25 个基点。今日资金面继续宽松，早盘大行及股份制银行融出隔夜至 7 天资金，午后流动性延续宽松，机构减点融出隔夜资金，大行、非银融出少量跨春节资金，买盘有限。

国家统计局今早公布数据显示，中国 2017 年 12 月规模以上工业企业利润同比增长 10.8%，中国 2017 年全国规模以上工业企业实现利润总额同比增长 21.0%，为 2011 年以来最快。

今日财政部发行的 91 天期国债中标利率为 3.2775%，边际利率为 3.3244%，全场倍数为 3.52 倍，边际倍数为 1.55 倍。国债期货全天窄幅震荡，小幅收红。10 年期国债期货主力合约 T1803 收报 91.905，较上个交易日上涨 0.10%，5 年期国债期货主力合约 TF1803 收报 95.960，较上个交易日上涨 0.05%。今日国债期货小幅偏强，然而现券收益率走势分化，金融债长端不降反升，10 年国开收益率明显上行。截至目前，剩余期限 9.58 年的国开债活跃券 170215 收益率报 5.09%/5.08%；剩余期限 9.77 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 6.3436，为 2015 年 11 月 5 日来最高，较上个交

易日上调 288 点。在岸人民币兑美元开盘急跌后大幅走强，随后回落震荡，午后继续走升，尾盘回吐部分涨幅，截至 16:30，在岸人民币兑美元报 6.3227，刷新 2015 年 10 月 30 日以来收盘新高，较上一交易日收盘价上涨 123 点。离岸人民币兑美元早盘先升后降，午后震荡回升，现报 6.3231，较上一交易日收盘价上涨 70 点，两岸汇差现在 15 点附近；美元指数全天震荡走弱，跌破 89 关口，现报 88.84，较上一交易日收盘价下跌 0.59%。

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。