

市场概述

Market Overview

【每日市场动态 20180109】在岸人民币跌破 6.52

文/ Ryan Rui

CFETS-NEX 2018/01/09

今日央行发布公告称，目前银行体系流动性总量吸收央行逆回购到期等因素后处于适中水平，不开展公开市场操作。逆回购到期 1300 亿元，资金净回笼 1300 亿元。Shibor 利率短端上涨、长端下行，其中隔夜品种报 2.5290%，上涨 6.80 个基点；7 天品种报 2.7440%，上涨 0.70 个基点；1 个月品种报 4.2209%，下跌 6.77 个基点；3 个月品种报 4.6570%，下跌 0.24 个基点。当前央行已连续 12 个交易日暂停公开市场操作，持续净回笼效应已逐渐显示，资金面较上周稍显收敛，今日早盘大行、股份制融出隔夜资金，并融入隔夜至 1 个月期限资金，午后股份制继续融出隔夜，同时融入减点隔夜资金，长期限方面，农商和非银融出跨春节资金。

今日发行的 1 年期、3 年期国开行固息增发债中标收益率分别为 3.9975%、

4.6269%，全场倍数分别为 4.12 倍、2.69 倍，边际倍数分别为 3.91 倍、8.85 倍。整体而言，今日两期国开债中标收益率低于市场预测均值，1 年期机构投标热情较好。

国债期货早盘低开震荡走高后回落，午后延续震荡态势，尾盘涨跌不一。10 年期国债期货主力合约 T1803 收报 92.645，较上个交易日下跌 0.01%，5 年期国债期货主力合约 TF1803 收报 96.410，较上个交易日上涨 0.02%。债券市场走势平稳，现券收益率小幅震荡，国债收益率下行约 2BP，国开债收益率上行约 0.5BP。截至目前，剩余期限 9.63 年的国开债活跃券 170215 收益率报 4.935%/4.9325%；剩余期限 9.82 年的国债活跃券 170025 收益率报 3.895%/3.89%。

周二人民币兑美元中间价报 6.4968，较上个交易日下跌 136 点。在岸人民币

兑美元早盘弱势震荡，午后跌幅加速扩大，跌破 6.52 关口，截至 16:30，在岸人民币兑美元报 6.5207，较上一交易日收盘价大幅下跌 251 点，离岸人民币兑美元同样大幅走弱，连续跌破多个整数关口，现报 6.5322，较上一交易日收盘价下挫 349 点，两岸汇差维持 75 点左右；美元指数午后大幅拉涨，现报 92.52，较

上一交易日收盘价上涨 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。