

市场概述

Market Overview

【每日市场动态 20171204】人民币中间价六连降

文/ Ryan Rui

CFETS-NEX 2017/12/04

月初流动性宽松，央行连续两个交易日暂停公开市场操作，逆回购到期 900 亿，资金净回笼 900 亿元。Shibor 利率短端下行，长端走高，其中隔夜品种报 2.6000%，下跌 4.20 个基点；7 天品种报 2.8160%，下跌 3.50 个基点；1 个月品种报 4.2384%，上涨 7.52 个基点；3 个月品种报 4.7804%，上涨 1.65 个基点。今日银行间市场流动性依旧十分充裕，早盘大行、股份制融出隔夜至 7 天资金，午后资金面继续宽松，大行继续融出隔夜，机构融入需求均可以得到满足；此外，银行类机构融出 21 天资金，买盘不多；非银高价融出 1 个月跨年资金，买盘需求有所增加。

国债期货早盘低开，随后维持弱势整理，临近午盘拉升走高，尾盘有所回落。10 年期国债期货主力合约 T1803 收报 92.990，较上个交易日下跌 0.01%，5 年

期国债期货主力合约 TF1803 收报 96.520，下跌 0.03%。周一资金面维持宽松态势，债市跟随国债期货走势波动，现券收益率日内冲高回落，较上周五变化不大，截至目前，剩余期限 9.73 年的国开债活跃券 170215 收益率报 4.8025%/4.7925%；剩余期限 9.67 年的国债活跃券 170018 收益率报 3.915%/3.895%。

周一人民币兑美元中间价报 6.6105，较上个交易日下调 38 点，为连续第六个交易日下调。在岸人民币兑美元全天震荡走弱，截至 16:30，在岸人民币兑美元报 6.6187，较上一交易日收盘价下跌 122 点；离岸人民币兑美元全天震荡走弱，现报 6.6198，较上一交易日收盘价下挫 229 点，两岸汇差目前维持在 20 点左右。美元指数早盘维持横盘整理，午后冲高回落，现报 93.16，较上一交易日收盘价上涨 0.30%。

上周五（12月1日）CFETS人民币汇率指数录得94.38，按周下行0.29；参考BIS货币篮子的人民币汇率指数录得95.24，按周下行0.25，参考SDR货币篮子的人民币汇率指数录得94.97，按周下行0.55。

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。