

市场概述 Market Overview

【每日市场动态 20170919】人民币兑美元大幅走弱

文/ Ryan Rui

CFETS-NEX 2017/09/19

今日央行公开市场进行 1300 亿 7 天期、200 亿 28 天期逆回购操作，无逆回购到期，资金净投放 1500 亿。Shibor 利率多数上涨，其中隔夜品种报 2.8320%，上涨 7.60 个基点；7 天品种报 2.8680%，上涨 2.40 个基点；1 个月品种报 3.9815%，上涨 1.48 个基点；3 个月品种报 4.3638%，下跌 0.05 个基点。今日早盘隔夜资金依旧紧张，融出有限，午后股份制银行开始融出隔夜资金，市场趋于均衡，7 天资金全天融出较少，至下午仍呈现偏紧态势；14 天以上融出多为高价，需求不多。

今日发行的 1 年期、5 年期、10 年期国开行固息增发债中标收益率分别为 3.7815%、4.2035%、4.1898%，全场倍数分别为 3.63、4.93、3.15 倍，边际倍数分别为 69、5.22、1.06 倍。

国债期货震荡走高，全线收涨。10 年

期国债期货主力合约 T1712 收报 95.185，涨 0.08%，5 年期国债期货主力合约 TF1712 收报 97.600，涨 0.09%。今日央行公开市场继续大量资金净投放，但资金面直至尾盘才有所改善，现券收益率小幅下行，截至目前，剩余期限 9.93 年的国开债活跃券 170215 收益率报 4.215%/4.21%；剩余期限 9.88 年的国债活跃券 170018 收益率报 3.62%/3.61%。

周二人民币兑美元中间价报 6.5530，较上个交易日下调 111 点。在岸、离岸人民币兑美元双双走弱，全天维持横盘弱势整理，一度跌破 6.59，截至 16:30，在岸人民币兑美元报收 6.5859，创 8 月底以来收盘新低，较上一交易日收盘价跌 241 点；离岸人民币兑美元现报 6.5860，较上一交易日收盘价下跌 121 点，两岸汇差目前在 15 点附近。美元指数震荡走弱，现报 91.96，较上一交易日

收盘价跌 0.08%。

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。