

市场概述 Market Overview

【每日市场动态 20171207】外储连续十个月上涨

文/ Ryan Rui

CFETS-NEX 2017/12/07

今日央行公开市场重启逆回购操作，进行了 1200 亿元 7 天期、500 亿元 14 天期逆回购操作、1000 亿元 28 天期逆回购操作，逆回购到期 2700 亿，资金零投放零回笼。Shibor 利率全线上涨，其中隔夜品种报 2.5850%，上涨 1.20 个基点；7 天品种 2.7910%，上涨 0.40 个基点；1 个月品种报 4.3950%，上涨 5.56 个基点；3 个月品种报 4.7873%，上涨 0.43 个基点。今日银行间市场流动性继续收敛，开盘资金面均衡偏紧，大行、股份制融入隔夜资金，临近午盘隔夜资金融出增多，股份制融出 7 天资金，流动性趋于宽松，午后资金面继续宽松，不乏减点隔夜融出。其余期限方面，14 天期限银行类交投活跃，21 天非银、农商融出，但机构融入需求有限。

今日下午央行公布数据显示，中国 11 月外汇储备为 31192.8 亿美元，略低于

预期的 31235 亿美元，前值为 31092 亿美元，11 月外汇储备环比增加 100.64 亿美元，已连续 10 个月上升。

今早发行的 1 年期、3 年期、5 年期进出口行固息增发债中标收益率分别为 4.1264%、4.6355%、4.7152%，全场倍数分别为 2.78、3.46、2.93 倍。下午发行的 1 年期、3 年期、5 年期、7 年期国开行固息增发债中标收益率分别为 3.2200%、4.6005%、4.6775%、4.7986%，全场倍数分别为 1.61、2.78、3.12、3.64 倍，此外发行的 3 年期国开置换债中标利率为 4.6793%，投标倍数为 1.23 倍。整体而言，今日发行金融债中标收益率略高于市场预期，机构需求一般。

国债期货宽幅震荡，走势偏弱，尾盘全线收跌。10 年期国债期货主力合约 T1803 收报 92.890，较上个交易日下跌 0.16%，5 年期国债期货主力合约 TF1803

收报 96.440，下跌 0.13%。今日资金面继续小幅收敛，现券收益率跟随国债期货小幅波动，尾盘明显下行，截至目前，剩余期限 9.72 年的国开债活跃券 170215 收益率报 4.75%/4.7425%；剩余期限 9.66 年的国债活跃券 170018 收益率报 3.885%。

周四人民币兑美元中间价报 6.6195，较上个交易日下调 32 点，连续第 9 个交易日下调。在岸人民币兑美元早盘直线跳水后一路走高，收复全部失地，午后震荡偏弱，截至 16:30，在岸人民币兑美元报 6.6155，较上一交易日收盘价微跌

5 点；离岸人民币兑美元早盘大幅拉升，跌幅明显收窄，午后震荡回落，现报 6.6196，较上一交易日收盘价下挫 18 点，两岸汇差目前维持在 45 点左右。美元指数早盘震荡走强，现报 93.67，较上一交易日收盘价上涨 0.12%。

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。