

市场概述 每日市场动态

常规报告系列



NEX 上海国际货币经纪
Shanghai CFETS-NEX International Money Broking

【2018-11-26】

今日央行发布公告称，由于临近月末财政支出增加，可对冲中央国库现金管理到期等因素的影响，为维护银行体系流动性合理充裕，不开展逆回购操作，今日无逆回购到期，国库现金定存到期 1000 亿元，资金净回笼 1000 亿元。Shibor 利率多数上涨，其中隔夜品种报 2.4980%，上涨 14.20 个基点；7 天品种报 2.6440%，上涨 1.60 个基点；1 个月品种报 2.6930%，上涨 0.20 个基点；3 个月品种报 3.0850%，上涨 1.20 个基点。今日资金面总体宽松，早盘隔夜融出较多，需求较快满足，随后隔夜融出渐少，部分大行有融入需求，偏紧状态延续至下午三点左右，此后资金面恢复宽松，7 天及以上期限融出较多、成交有限。

今日发行的 3 年期、5 年期农发行固息增发债加权中标收益率分别为 3.2704%、3.5415%，全场倍数分别为 4.93 倍、3.84 倍，边际倍数分别为 2.5 倍、1 倍。国债期货早盘高开后一路下行，午后短暂回调后再度下行，临近尾盘有所回升。10 年期国债期货主力合约 T1903 收报 96.465，较上个交易日下跌 0.18%；5 年期国债期货主力合约 TF1903 收报 98.65，较上个交易日下跌 0.12%；2 年期国债期货主力合约 TS1903 收报 99.60，较上个交易日下跌 0.02%。今日现券收益率震荡上行。截至目前，剩余期限 9.61 年的国开债活跃券 180210 收益率报 3.9125%/3.9125%，剩余期限 9.72 年的国债活跃券 180019 收益率报 3.42%/3.40%。

周一人民币兑美元中间价报 6.9453，较上个交易日下调 147 点。在岸、离岸人民币兑美元全天均一路上行，截至 16:30，在岸人民币兑美元收报 6.9453，较上一交易日官方收盘价下跌 74 点，离岸人民币兑美元现报 6.9328，较上一交易日下跌 117 点，目前两岸汇差倒挂在 125 点附近。美元指数早盘短暂上行，随后全天走低，现报 96.7163，较上一交易日下跌 0.24%。

上周五（11 月 23 日）CFETS 人民币汇率指数录得 92.33，按周下行 0.15；参考 BIS 货币篮子的人民币汇率指数录得 95.98，按周下行 0.19，参考 SDR 货币篮子的人民币汇率指数录得 92.32，按周下行 0.24。

以上仅供参考，谢谢！

文/Ellen Liu

如果您对本文有任何评论与见解
请发电邮至：SHResearch@cfets-nex.com.cn

扫描二维码 轻松查看晨报及更多资讯



免责声明：

文中信息均来自公开资料，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。

WWW.CFETS-NEX.COM.CN