

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

【2018-12-12】

今日央行发布公告称，由于目前银行体系流动性总量处于合理充裕水平，不开展逆回购操作，今日无逆回购到期，资金零投放零回笼。Shibor 利率多数上涨，其中隔夜品种报 2.4240%，下跌 3.90 个基点；7 天品种报 2.6260%，上涨 0.20 个基点；1 个月品种报 2.8740%，上涨 2.60 个基点；3 个月品种报 3.1470%，上涨 0.20 个基点。今日资金面总体宽松，早盘隔夜融入、融出均有大量，成交较多，午后部分城商行有补头寸需求，资金略有趋紧，隔夜成交在加权，7 天期限以融出为主，14 天及以上需求寥寥，1 个月期限融出价格较高，成交有限。

今早财政部发行的 2 年期、5 年期附息国债中标加权收益率分别为 2.6009%、2.9269%，边际利率分别为 2.6880%、2.9819%，全场倍数分别为 1.94 倍、2.15 倍，边际倍数分别为 3.73 倍、2.25 倍。国债期货早盘低开高走，午后涨幅扩大，尾盘再度回落，勉强收红。10 年期国债期货主力合约 T1903 收报 97.30，较上个交易日上涨 0.01%；5 年期国债期货主力合约 TF1903 收报 99.195，较上个交易日上涨 0.05%；2 年期国债期货主力合约 TS1903 收报 100.115，较上个交易日持平。今日债市交投一般，市场已基本消化信贷数据的冲击，现券收益率震荡下行。截至目前，剩余期限 9.56 年的国开债活跃券 180210 收益率报 3.67%/3.6675%，剩余期限 9.68 年的国债活跃券 180019 收益率报 3.2825%/3.265%。

周三人民币兑美元中间价报 6.9064，较上个交易日下调 68 点。在岸人民币兑美元全天维持强势，早盘高开后小幅回落，随后窄幅震荡，截至 16:30，在岸人民币兑美元收报 6.8893，较上一交易日官方收盘价收涨 97 点；离岸人民币兑美元走势强劲，现报 6.8882，较上一交易日上涨 190 点。美元指数全天大幅震荡，总体走势偏弱，现报 97.39，较上一个交易日下跌 0.09%。

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