

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

【2019-01-03】

今日央行公开市场进行 400 亿 7 天期、200 亿 14 天期逆回购操作，逆回购到期 1500 亿，资金净回笼 900 亿元。Shibor 利率全线下跌，其中隔夜品种报 1.9680%，下跌 33.20 个基点；7 天品种报 2.5470%，下跌 8.70 个基点；1 个月品种报 3.0840%，下跌 11.60 个基点；3 个月品种报 3.2460%，下跌 3.90 个基点。今日资金面宽松，早盘隔夜以融出为主，融入需求有限，需求较快满足，7 天、14 天期限加权成交，午后资金面延续宽松态势，部分机构有跨春节资金需求，资金融出以银行为主，更长期限需求寥寥。

今日发行的 1 年期、3 年期、5 年期、7 年期、10 年期国开行固息增发债加权中标利率分别为 2.54%、3.0484%、3.2982%、3.6023%、3.48%，全场倍数分别为 3.35 倍、4.36 倍、3.5 倍、2.62 倍、3.19 倍，边际倍数分别为 12.56 倍、1.19 倍、1.64 倍、1.21 倍、1.67 倍。早盘国债期货大幅高开后快速走低，随后震荡回升，午盘翻红，尾盘小幅回落后回升。10 年期国债期货主力合约 T1903 收报 98.160，较上个交易日上涨 0.09%；5 年期国债期货主力合约 TF1903 收报 99.610，较上个交易日上涨 0.03%；2 年期国债期货主力合约 TS1903 收报 100.340，较上个交易日上涨 0.02%。今日现券收益率总体震荡下行，下行幅度约 2BP。截至目前，剩余期限 9.5 年的国开债活跃券 180210 收益率报 3.585%/3.575%，剩余期限 9.62 年的国债活跃券 180019 收益率报 3.16%/--%。

周四人民币兑美元中间价报 6.8631，较上个交易日下调 149 点。在岸人民币兑美元早盘低开，随后下行，午后有所回升，截至 16:30，在岸人民币兑美元收报 6.8721，较上一交易日官方收盘价下跌 203 点；离岸人民币兑美元早盘冲高回落，午后回升，现报 6.8822，较上一交易日下跌 26 点，两岸汇差目前在 101 点附近。美元指数早盘走低，午后小幅回升，现报 96.5727，较上一个交易日下跌 0.22%。

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