

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

【2019-01-16】

考虑到目前仍处于税期高峰，为维护银行体系流动性合理充裕，今日央行公开市场进行了 3500 亿元 7 天期、2200 亿元 28 天期逆回购操作，逆回购资金到期 100 亿，资金净投放 5600 亿元，逆回购操作规模及单日净投放量均创有纪录以来新高。Shibor 利率多数下跌，其中，隔夜品种报 2.3060%，上涨 6.10 个基点；7 天品种报 2.6400%，下跌 1.20 个基点；1 个月品种报 2.7770%，较上个交易日持平；3 个月品种报 2.9420%，下跌 2.00 个基点。今日资金面总体宽松，早盘隔夜、7 天均价融出，14 天加权融出，午后宽松形势不改，隔夜有减点成交。

今早发行的 1 年期、10 年期附息国债加权利率分别为 2.31%、3.0328%，边际利率分别为 2.35%、3.0629%，全场倍数分别为 3.18 倍、3.13 倍，边际倍数分别为 7.73 倍、1.44 倍；下午发行的 1 年期、7 年期、10 年期农发行固息债加权利率分别为 2.3854%、3.6156%、3.6828%，全场倍数分别为 5.17 倍、3.68 倍、2.79 倍，边际倍数分别为 8.83 倍、1.13 倍、15.62 倍。受央行资金投放力度加大，债券一级招标火热等因素影响，国债期货早盘高开高走，全天持续上行。10 年期国债期货主力合约 T1903 收报 98.295，较上个交易日上涨 0.57%；5 年期国债期货主力合约 TF1903 收报 99.865，较上个交易日上涨 0.35%；2 年期国债期货主力合约 TS1903 收报 100.605，较上个交易日上涨 0.14%。现券收益率持续下行，国债收益率下行幅度超过金融债，截至目前，剩余期限 9.47 年的国开债活跃券 180210 收益率报 3.5775%/3.575%，剩余期限 9.58 年的国债活跃券 180019 收益率报 3.14%/--%。

周三人民币兑美元中间价报 6.7615，较上个交易日下调 73 点。在岸人民币兑美元早盘大幅低开后短暂下行，随后一路反弹，截至 16:30，在岸人民币兑美元收报 6.7550，较上一交易日官方收盘价下跌 6 点；离岸人民币兑美元早盘跳水，随后全天走强，现报 6.7638，较上一交易日官方收盘价上涨 99 点，目前两岸汇差在 88 点附近。美元指数全天震荡，现报 95.91，较上一交易日下跌 0.04%。

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