

# 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

【2019-01-07】

今日央行发布公告称，目前银行体系流动性总量处于较高水平，不开展逆回购操作，逆回购到期 1700 亿，资金净回笼 1700 亿元。Shibor 利率全线下跌，其中，隔夜品种报 1.4470%，下跌 20.20 个基点；7 天品种报 2.4750%，下跌 8.80 个基点；1 个月品种报 2.9090%，下跌 10.10 个基点；3 个月品种报 3.1410%，下跌 7.40 个基点。今日资金面全天宽松，各期限资金纷纷融出，早盘隔夜即有减点融出，需求较快满足，7 天-21 天成交有限，跨春节资金以融出为主，更长期限成交较少。

今日公布的数据显示，中国 12 月外汇储备 30727.1 亿美元，高于预期和前值，2018 年末中国外汇储备 30727.12 亿美元，相比 2017 年末减少 672.37 亿美元。

今日发行的 3 年期、5 年期农发行固息增发债加权中标利率分别为 3.101%、3.3633%，全场倍数分别为 5.1 倍、4.79 倍，边际倍数分别为 1.78 倍、6.25 倍。受今日资金面宽松等因素影响，国债期货早盘低开震荡上行，午后走低，随后维持震荡至尾盘。10 年期国债期货主力合约 T1903 收报 97.935，较上个交易日上涨 0.04%；5 年期国债期货主力合约 TF1903 收报 99.560，较上个交易日上涨 0.06%；2 年期国债期货主力合约 TS1903 收报 100.335，较上个交易日下跌 0.01%。今日现券收益率窄幅震荡，小幅上行，截至目前，剩余期限 9.49 年的国开债活跃券 180210 收益率报 3.58%/3.5775%，剩余期限 9.61 年的国债活跃券 180019 收益率报 3.16%。

周一人民币兑美元中间价报 6.8517，较上个交易日上调 69 点。在岸人民币兑美元早盘大幅高开，全天维持窄幅震荡，午后小幅下行，截至 16:30，在岸人民币兑美元收报 6.8499，较上一交易日官方收盘价上涨 146 点；离岸人民币兑美元早盘上行，午后小幅回落，回吐部分涨幅，现报 6.8483，较上一交易日上涨 170 点，两岸汇差目前倒挂在 16 点附近。美元指数全天一路下行，现报 95.91，较上一个交易日下跌 0.32%。

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**