

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

【2018-12-18】

今日央行公开市场进行 1400 亿元 7 天期、400 亿 14 天期逆回购操作，无逆回购到期，资金净投放 1800 亿元。Shibor 利率多数上涨，其中隔夜品种报 2.6690%，上涨 4.40 个基点；7 天品种报 2.6940%，下跌 0.30 个基点；1 个月品种报 3.0340%，上涨 3.20 个基点；3 个月品种报 3.1740%，上涨 1.00 个基点。今日资金面整体偏紧，早盘隔夜资金大幅加点融出，且融出很少，午后紧张态势延续至 3 点左右，随后资金融出渐多，7 天期限融出较少，价格较昨日上行，14 天、21 天跨年资金价格较昨日也有所上行。

今日国债期货早盘大幅低开，全天震荡上行，午后翻红。10 年期国债期货主力合约 T1903 收报 96.470，较上个交易日上涨 0.05%；5 年期国债期货主力合约 TF1903 收报 98.690，较上个交易日上涨 0.04%；2 年期国债期货主力合约 TS1903 收报 100.015，较上个交易日上涨 0.02%。自周一起央行重启公开市场逆回购操作，央行维稳资金面意图明显，现券收益率高开低走。截至目前，剩余期限 9.55 年的国开债活跃券 180210 收益率报 3.795%/3.7925%，剩余期限 9.66 年的国债活跃券 180019 收益率报 3.38%/--%。

周二人民币兑美元中间价报 6.8854，较上个交易日上调 54 点。在岸人民币兑美元早盘高开后一路下行，临近尾盘回升，截至 16:30，在岸人民币兑美元收报 6.8927，较上一交易日官方收盘价收涨 77 点；离岸人民币兑美元早盘冲高回落，午后有所回升，现报 6.8943，较上一交易日上涨 65 点，两岸汇差在 16 点附近。美元指数早盘震荡，午后跳水，现报 96.94，较上一个交易日下跌 0.21%。

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