市场概述
每日市场动态

常规报告系列

上海国际货币经纪
Shanghai CFETS-NEX International Money Broking

【2018-12-04】

今日央行发布公告称，由于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，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 2.4450%，下跌 7.00 个基点；7 天品种报 2.6210%，上涨 0.30 个基点；1 个月品种报 2.7450%，上涨 3.10 个基点；3 个月品种报 3.1260%，上涨 0.90 个基点。今日各期限资金面均维持宽松，早盘隔夜减点融出幅度较大，需求较快满足，午后流动性维持充裕态势，少量机构有补头寸需求，7 天、14 天期限以融出为主，成交有限，更长期限方面，少量大行资管和城商行有 1 个月跨元旦资金需求。

今日发行的 3 年期、5 年期、7 年期、10 年期国开行固息增发债加权中标收益率分别为 3.2966%、3.5156%、3.7942%、3.7368%，全场倍数分别为 2.14 倍、2.74 倍、3.36 倍、3.89 倍，边际倍数分别分别为 1.99 倍、5.6 倍、1.33 倍、23.75 倍。国债期货早盘大幅高开后横盘震荡，午后整体上行，尾盘略有回落。10 年期国债期货主力合约 T1903 收报 97.06，较上个交易日上涨 0.30%；5 年期国债期货主力合约 TF1903 收报 98.97，较上个交易日上涨 0.14%；2 年期国债期货主力合约 TS1903 收报 100.06，较上个交易日上涨 0.11%。今日债市交投活跃，收益率明显下行。截至目前，剩余期限 9.59 年的国开债活跃券 180210 收益率报 3.76%/3.755%，剩余期限 9.70 年的国债活跃券 180019 收益率报 3.3175%/--%。

周二人民币兑美元中间价报 6.8939，较上个交易日上调 492 点。在岸人民币兑美元早盘小幅高开后一路上行，午后高位震荡，截至 16:30，在岸人民币兑美元收报 6.8401，较上一交易日官方收盘价大幅涨 484 点；离岸人民币兑美元早盘震荡整理后一路上涨，午后维持震荡，现报 6.8408，较上一交易日大幅上涨 361 点，目前两岸汇差在 7 点附近。美元指数全天一路震荡下跌，尾盘小幅回升，现报 96.66，较上一交易日下挫 0.31%。

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。