

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

【2019-02-18】

今日央行发布公告称，考虑到现金回笼等因素推动流动性总量上升，为维护银行体系流动性合理充裕，不开展逆回购操作，今日亦无逆回购到期，资金零投放零回笼。Shibor 利率短端上行，长端下行，其中隔夜品种报 1.8224%，上涨 10.94 个基点；7 天品种报 2.3950%，上涨 4.40 个基点；1 个月品种报 2.6870%，下跌 1.10 个基点；3 个月品种报 2.7970%，下跌 0.50 个基点。今日隔夜资金早盘宽松，午后趋于均衡，7 天期限融出较多，14 天跨越期限总体均衡、21 天期限交投清淡，1 个月期限以融出为主，2 个月跨季资金需求较上个交易日。

今日发行的 3 年期、5 年期农发行固息增发债中标利率分别为 2.9712%、3.273%，全场倍数分别为 2.71、2.32 倍，边际倍数分别为 1.57、6.29 倍。今日国债期货早盘低开，随后维持横盘整理态势，午后两点大幅跳水，跌幅扩大。10 年期国债期货主力合约 T1903 收报 97.785，较上个交易日下跌 0.25%；5 年期国债期货主力合约 TF1903 收报 99.720，较上个交易日下跌 0.20%；2 年期国债期货主力合约 TS1903 收报 100.485，较上个交易日下跌 0.02%。受中美经贸磋商平稳进行以及 1 月金融数据超预期等影响，今日三大股指全线逼空，债市承压，现券收益率震荡上行，十年期国开收益率上行约 4BP。截至目前，剩余期限 9.38 年的国开债活跃券 180210 收益率报 3.67%/3.6675%，剩余期限 9.49 年的国债活跃券 180019 收益率报 3.15%/3.13%。

周一人民币兑美元中间价报 6.7659，较上个交易日下调 36 点。在岸人民币兑美元早盘高开震荡，午后回吐部分涨幅，截至 16:30，在岸人民币兑美元收报 6.7671，较上个交易日官方收盘价上涨 131 点；离岸人民币兑美元震荡走弱，现报 6.7743，较上一交易日官方收盘价下跌 40 点，目前两岸汇差在 75 点附近。美元指数早盘低开，日内震荡走升，现报 96.84，较上一交易日下跌 0.06%。

外汇交易中心公布数据显示，上周五（2 月 15 日）CFETS 人民币汇率指数录得 94.38，按周上涨 0.17；参考 BIS 货币篮子的人民币汇率指数录得 97.99，按周上涨 0.18，参考 SDR 货币篮子的人民币汇率指数录得 94.78，按周下跌 0.01。

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