



【2018-12-26】

今日央行公开市场进行 200 亿 7 天期、100 亿 14 天期逆回购操作，逆回购到期 400 亿，资金净回笼 100 亿元。Shibor 利率全线上涨，其中隔夜品种报 2.0290%，上涨 0.10 个基点；7 天品种报 2.6720%，上涨 1.90 个基点；1 个月品种报 3.3970%，上涨 9.50 个基点；3 个月品种报 3.3090%，上涨 3.60 个基点。今日早盘隔夜减点融出较多，需求较快满足，7 天跨年资金仅有少量高价融出，14 天期限同样偏紧，更长期限成交有限，午后年内资金面维持宽松，跨年资金继续偏紧。

今日发行的 3 年期、5 年期、10 年期进出口行固息增发债中标利率分别为 3.3745%、3.6074%、3.8852%，全场倍数分别为 3.42 倍、2.81 倍、2.82 倍，边际倍数分别为 1.97 倍、2.48 倍、3.58 倍。今早国债期货小幅低开后持续震荡，午后大幅拉升。10 年期国债期货主力合约 T1903 收报 97.295，较上个交易日上涨 0.27%；5 年期国债期货主力合约 TF1903 收报 99.160，较上个交易日上涨 0.14%；2 年期国债期货主力合约 TS1903 收报 100.165，较上个交易日上涨 0.04%。临近年末，债市交投清淡，受国债期货午后翻红影响，现券收益率小幅下行。截至目前，剩余期限 9.53 年的国开债活跃券 180210 收益率报 3.72%/3.7175%，剩余期限 9.64 年的国债活跃券 180019 收益率报 3.30%/3.28%。

周三人民币兑美元中间价报 6.8845，较上个交易日上调 74 点。在岸人民币兑美元早盘弱势震荡，午后震荡上行，截至 16:30，在岸人民币兑美元收报 6.8821，较上一交易日官方收盘价上涨 39 点；离岸人民币兑美元全天震荡上行，现报 6.8938，较上一交易日上涨 26 点，两岸汇差目前在 117 点附近。美元指数早盘走弱，随后全天震荡回升，现报 96.66，较上一个交易日持平。

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