

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

【2019-01-31】

今日央行开展 500 亿元 14 天期逆回购操作，无逆回购到期，资金净投放 500 亿。Shibor 利率隔夜期限显著上涨，其余期限下跌，其中隔夜品种报 2.2380%，上涨 23.59 个基点；7 天品种报 2.7560%，下跌 0.90 个基点；1 个月品种报 2.8390%，下跌 0.10 个基点；3 个月品种报 2.9000%，下跌 0.10 个基点。今日资金面总体宽松，早盘隔夜加权融出，7 天、14 天跨春节期限各类机构均有融出，需求得到满足，有机构约出明日资金，更长期限以融出为主。

今日发行的 1 年期、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 2.3714%、2.9600%、3.2800%、3.7329%，全场倍数分别为 3.62 倍、3.32 倍、3 倍、4.13 倍，边际倍数分别为 1.21 倍、1.83 倍、2.29 倍、1.43 倍。国债期货高开高走，随后维持震荡，尾盘跳水后小幅回升。10 年期国债期货主力合约 T1903 收报 98.030，较上个交易日上涨 0.08%；5 年期国债期货主力合约 TF1903 收报 99.865，较上个交易日上涨 0.08%；2 年期国债期货主力合约 TS1903 收报 100.390，较上个交易日上涨 0.03%。今日债券市场成交依旧清淡，早盘低开后小幅走升，收益率较昨日略低，截至目前，剩余期限 9.43 年的国开债活跃券 180210 收益率报 3.6175%/3.615%，剩余期限 9.54 年的国开活跃券 180019 收益率报 3.12%/3.11%。

周四人民币兑美元中间价报 6.7025，较上个交易日上调 318 点。在岸人民币兑美元早盘高开，全天维持震荡，截至 16:30，在岸人民币兑美元收报 6.7055，较上个交易日官方收盘价上涨 76 点；离岸人民币兑美元全天震荡，现报 6.7154，较上一交易日官方收盘价下跌 42 点，目前两岸汇差在 99 点附近。美元指数全天震荡偏弱，现报 95.25，较上一交易日下跌 0.20%。

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