



【2018-12-07】

今日央行发布公告称，考虑到开展 1000 亿元中央国库现金管理商业银行定期存款操作后，银行体系流动性总量处于合理充裕水平，不开展逆回购操作，今日无逆回购到期，资金净投放 1000 亿元。Shibor 利率除隔夜品种外全线上涨，其中隔夜品种报 2.4160%，下跌 0.20 个基点；7 天品种报 2.6110 %，上涨 1.10 个基点；1 个月品种报 2.8280%，上涨 1.80 个基点；3 个月品种报 3.1360%，上涨 0.30 个基点。今日资金面全天维持宽松，隔夜多以加权成交，减点融出不多，14 天、21 天，以及跨年资金价格较昨日上行。

财政部今早发行的 91 天期、182 天期贴现国债加权中标利率分别为 2.3704%、2.4784%，边际利率分别为 2.4536%、2.5592%，全场倍数分别为 1.86 倍、2.07 倍，边际倍数分别为 6.71 倍、1.26 倍。国债期货早盘低开跳水，一度跌逾 0.2%，随后逐步回升，午后震荡翻红，小幅收涨。10 年期国债期货主力合约 T1903 收报 97.170，较上个交易日上涨 0.03%；5 年期国债期货主力合约 TF1903 收报 99.075，较上个交易日上涨 0.05%；2 年期国债期货主力合约 TS1903 收报 100.120，较上个交易日上涨 0.02%。现券收益率早盘低开高走，午后小幅震荡，较昨日略有下行。截至目前，剩余期限 9.58 年的国开债活跃券 180210 收益率报 3.7175%/3.715%，剩余期限 9.69 年的国债活跃券 180019 收益率报--%/3.285%。

周五人民币兑美元中间价报 6.8664，较上个交易日下调 65 点。在岸人民币兑美元早盘低开后反弹拉升，午后回吐大部分涨幅，截至 16:30，在岸人民币兑美元收报 6.8798，较上一交易日官方收盘价上涨 39 点；离岸人民币兑美元早盘开盘下跌后一路回升，午后震荡回落，现报 6.8810，较上一交易日微涨 4 点，目前两岸汇差在 5 点附近。美元指数早盘大幅震荡，午后冲高回落，现报 96.85，较上一交易日上涨 0.08%。央行午后公布数据显示，中国 11 月外汇储备 30617 亿美元，高于预期的 30440 亿美元以及前值的 30531 亿美元，环比增加 86 亿美元，终结三连降，10 月环比减少 339 亿美元。

以上仅供参考，谢谢！

文/Ryan Rui

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