

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

【2019-01-25】

今日央行发布公告称，受下调存款准备金率 0.5 个百分点等因素影响，银行体系流动性总量处于较高水平，不开展逆回购操作，逆回购到期 100 亿，资金净回笼 100 亿。Shibor 利率短期上涨、长期下跌，其中隔夜品种报 2.3620%，上涨 9.90 个基点；7 天品种报 2.6260%，上涨 1.00 个基点；1 个月品种报 2.8190%，上涨 0.80 个基点；3 个月品种报 2.9020%，下跌 0.20 个基点。今日资金面早盘均衡、午盘略有收紧，尾盘资金面宽松、隔夜有减点融出，7 天期限需求有限，14 天、21 天跨春节资金面较昨日类似、各类机构均有融出，1 个月期限融出较多，更长期限需求寥寥。

今日发行的 91 天期贴现国债中标利率为 2.2304%，边际利率为 2.2507%，全场倍数为 3.49 倍，边际倍数为 1 倍，认购情绪较为高涨。国债期货早盘低开，随后维持弱势震荡，全天收跌。10 年期国债期货主力合约 T1903 收报 97.635，较上个交易日下跌 0.18%；5 年期国债期货主力合约 TF1903 收报 99.565，较上个交易日下跌 0.10%；2 年期国债期货主力合约 TS1903 收报 100.400，较上个交易日下跌 0.05%。近期，受股票市场连续上涨等因素影响，债市有所调整，现券收益率高开高走，截至目前，剩余期限 9.44 年的国开债活跃券 180210 收益率报 3.68%/3.6775%，剩余期限 9.82 年的国债活跃券 180019 收益率报 3.16%/3.155%。

周五人民币兑美元中间价报 6.7941，较上个交易日下调 139 点。在岸、离岸人民币兑美元全天双双走高，尾盘小幅回落，截至 16:30，在岸人民币兑美元收报 6.7640，较上一交易日官方收盘价上涨 305 点；离岸人民币兑美元现报 6.7749，较上一交易日官方收盘价上涨 203 点，目前两岸汇差在 109 点附近。美元指数早盘下行，午盘起持续震荡，现报 96.43，较上一交易日下跌 0.12%。

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