



【2019-02-11】

今日央行发布公告称，目前银行体系流动性总量处于较高水平，可吸收金融机构缴存法定存款准备金等因素的影响，不开展逆回购操作，逆回购到期 200 亿，资金净回笼 200 亿。Shibor 利率短端上涨、长端下跌，其中隔夜品种报 2.2650%，上涨 17.90 个基点；7 天品种报 2.5960%，上涨 26.20 个基点；1 个月品种报 2.7850%，下跌 2.30 个基点；3 个月品种报 2.8980%，下跌 0.20 个基点。今日资金面总体宽松，隔夜期限融出较多，早盘即有减点融出，7 天期限需求有限，14 天及更长期限均有大行融出，但需求较少，午后资金面依旧宽松。

今日国债期货早盘弱势震荡，午盘起一路走高，尾盘小幅回落。10 年期国债期货主力合约 T1903 收报 98.285，较上个交易日上涨 0.31%；5 年期国债期货主力合约 TF1903 收报 100.015，较上个交易日上涨 0.19%；2 年期国债期货主力合约 TS1903 收报 100.505，较上个交易日上涨 0.16%。今日现券收益率小幅下行，截至目前，剩余期限 9.4 年的国开债活跃券 180210 收益率报 3.60%/3.595%，剩余期限 9.51 年的国债活跃券 180019 收益率报 3.095%/--%。

周一人民币兑美元中间价报 6.7495，较上个交易日下调 414 点。在岸人民币兑美元早盘大幅低开，全天震荡下行，截至 16:30，在岸人民币兑美元收报 6.7804，较上个交易日官方收盘价下跌 413 点；离岸人民币兑美元全天震荡走低，现报 6.7953，较上一交易日官方收盘价下跌 106 点，目前两岸汇差在 149 点附近。美元指数全天震荡上行，现报 96.71，较上一交易日上涨 0.08%。

节前最后一个交易日（2 月 1 日）CFETS 人民币汇率指数录得 94.21，按周上涨 0.43；参考 BIS 货币篮子的人民币汇率指数录得 97.81，按周上涨 0.44，参考 SDR 货币篮子的人民币汇率指数录得 94.79，按周上涨 0.74。

今日公布的数据显示，中国 1 月外汇储备 30879.2 亿美元，预期 30800 亿美元，前值 30727.1 亿美元，环比连续三个月增加。

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