



【2018-12-20】

今日央行公开市场进行 300 亿元 7 天期、200 亿 14 天期逆回购操作，无逆回购到期，国库现金定存到期 1200 亿，资金净回笼 700 亿元。Shibor 利率涨跌互现，其中隔夜品种报 2.4860%，下跌 8.10 个基点；7 天品种报 2.6490%，下跌 2.70 个基点；1 个月品种报 3.1540%，上涨 4.20 个基点；3 个月品种报 3.2090%，上涨 1.00 个基点。今日年内资金面宽松，早盘隔夜融出较多，需求较快满足，午后宽松态势延续，7 天期限维持宽松，14 天、21 天跨年资金维持紧张态势，融出价格较高，更长期限成交较少。

今日发行的 91 天期贴现国债加权中标利率分别为 2.71%，边际利率为 2.8193%，全场倍数为 1.91 倍，边际倍数为 17 倍。国债期货早盘短暂下行后快速拉升，随后震荡下行，临近尾盘翻绿。10 年期国债期货主力合约 T1903 收报 96.900，较上个交易日下跌 0.07%；5 年期国债期货主力合约 TF1903 收报 98.925，较上个交易日下跌 0.03%；2 年期国债期货主力合约 TS1903 收报 100.07，较上个交易日下跌 0.03%。今日现券收益率早盘平开，窄幅震荡，午后收益率震荡走升。截至目前，剩余期限 9.54 年的国开债活跃券 180210 收益率报 3.7425%/3.74%，剩余期限 9.65 年的国债活跃券 180019 收益率报--%/3.315%。

周五人民币兑美元中间价报 6.8825，较上个交易日上调 111 点。在岸人民币兑美元早盘高开，全天震荡下行，截至 16:30，在岸人民币兑美元收报 6.9019，较上一交易日官方收盘价收跌 49 点；离岸人民币兑美元全天一路下行，现报 6.9066，较上一交易日下跌 133 点，两岸汇差在 47 点附近。美元指数早盘上行，午后走低，现报 96.34，较上一个交易日下跌 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