



【2018-12-17】

今日央行公开市场进行 1600 亿元 7 天期逆回购操作，无逆回购到期，资金净投放 1600 亿元。Shibor 利率多数上涨，其中隔夜品种报 2.6250%，下跌 3.00 个基点；7 天品种报 2.6970%，上涨 1.40 个基点；1 个月品种报 3.0020 %，上涨 3.60 个基点；3 个月品种报 3.1640%，上涨 0.80 个基点。今日资金面整体偏紧，早盘隔夜资金融入需求较大、融出有限，午后大行隔夜需求依旧存在，资金面维持紧张，临近尾盘隔夜和 7 天资金融出渐多，资金面转松， 14 天期限跨年资金融出较少，价格成交在较高水平，更长期限需求寥寥。

今日国债期货早盘全天窄幅震荡，临近尾盘跳水走低。10 年期国债期货主力合约 T1903 收报 96.260，较上个交易日大幅下挫 0.35%；5 年期国债期货主力合约 TF1903 收报 98.570，较上个交易日下挫 0.23%；2 年期国债期货主力合约 TS1903 收报 100.010，较上个交易日下跌 0.01%。受资金面收紧、国债期货走弱以及中央经济工作会议召开在即等因素影响，今日债市走低，现券收益率震荡上行。截至目前，剩余期限 9.55 年的国开债活跃券 180210 收益率报 3.8375%/3.835%，剩余期限 9.66 年的国债活跃券 180019 收益率报--%/3.39%。

周一人民币兑美元中间价报 6.8908，较上个交易日下调 158 点。在岸人民币兑美元早盘低开，全天维持震荡，截至 16:30，在岸人民币兑美元收报 6.9004，较上一交易日官方收盘价收跌 29 点；离岸人民币兑美元全天震荡，现报 6.8992，较上一交易日上涨 31 点，两岸汇差倒挂在 12 点附近。美元指数早盘震荡，午后下行，现报 97.37，较上一个交易日下跌 0.07%。今日央行发布的数据显示，11 月末央行口径外汇占款 21.26 万亿元，余额创近 8 年新低，环比下滑 571.3 亿元，为连续第四个月环比下降。

上周五（12 月 14 日）CFETS 人民币汇率指数录得 93.28，按周上行 0.10；参考 BIS 货币篮子的人民币汇率指数录得 97.06，按周上行 0.14；参考 SDR 货币篮子的人民币汇率指数录得 93.39，按周上行 0.08。

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