



【2018-12-24】

今日央行公开市场进行 200 亿 14 天期逆回购操作，逆回购到期 1600 亿，资金净回笼 1400 亿元。Shibor 利率短端下行，长端上涨，其中隔夜品种报 2.3160%，下跌 17.00 个基点；7 天品种报 2.6590%，上涨 1.00 个基点；1 个月品种报 3.2320%，上涨 7.80 个基点；3 个月品种报 3.2300%，上涨 2.10 个基点。今日央行公开市场净回笼，年内资金面总体宽松，跨年资金面偏紧，早盘隔夜融出较多，7 天跨年资金高价融出，14 天期限融出较少、成交价格较高，更长期限成交有限。

国债期货早盘低开，冲高回落后维持震荡，尾盘再度下挫。10 年期国债期货主力合约 T1903 收报 96.800，较上个交易日下跌 0.18%；5 年期国债期货主力合约 TF1903 收报 98.890，较上个交易日下跌 0.10%；2 年期国债期货主力合约 TS1903 收报 100.105，较上个交易日上涨 0.01%。临近年末，国内政策消息密集发布，债市短期波动加剧。今日债市交投清淡，现券收益率早盘小幅低开，随后震荡走升，十年期国开收益率小幅上行约 2.50BP。截至目前，剩余期限 9.53 年的国开债活跃券 180210 收益率报 3.7525%/3.75%，剩余期限 9.64 年的国债活跃券 180019 收益率报 3.36%/3.335%。

周一人民币兑美元中间价报 6.9006，较上个交易日下调 181 点。在岸人民币兑美元走弱后直线拉升，由跌转涨，午后维持震荡偏强态势，截至 16:30，在岸人民币兑美元收报 6.8965，较上一交易日官方收盘价上涨 54 点；离岸人民币兑美元早盘走强后窄幅震荡，现报 6.9051，较上一交易日上涨 187 点，两岸汇差目前在 80 点附近。美国政府停摆即将进入第三天，美元指数日内走势低迷，现报 96.72，较上一个交易日下跌 0.23%。

上周五（12 月 21 日）CFETS 人民币汇率指数录得 92.91，按周下跌 0.37；参考 BIS 货币篮子的人民币汇率指数录得 96.43，按周下跌 0.63，参考 SDR 货币篮子的人民币汇率指数录得 92.82，按周下跌 0.57。

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