

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

【2018-12-10】

今日央行发布公告称，由于目前银行体系流动性总量处于合理充裕水平，可吸收国债发行缴款等因素的影响，不开展逆回购操作，今日无逆回购到期，资金零投放零回笼。Shibor 利率全数上涨，其中隔夜品种报 2.4530%，上涨 3.70 个基点；7 天品种报 2.6150%，上涨 0.40 个基点；1 个月品种报 2.8380%，上涨 1.00 个基点；3 个月品种报 3.1420%，上涨 0.60 个基点。今日资金面总体宽松，早盘隔夜减点融出，成交集中在减点，临近尾盘部分股份制银行有补头寸需求，随着需求得到满足，资金面恢复宽松状态，7 天、14 天以融出为主，21 天期限需求寥寥，部分非银和大行资管有 1 个月跨月资金需求，但成交有限。

今日发行的 3 年期农发行固息增发债加权中标收益率为 1.9489%，全场倍数为 2.48 倍，边际倍数为 4 倍。国债期货早盘大幅高开后维持震荡，午后下探，随后震荡反弹。10 年期国债期货主力合约 T1903 收报 97.285，较上个交易日上涨 0.18%；5 年期国债期货主力合约 TF1903 收报 99.155，较上个交易日上涨 0.13%；2 年期国债期货主力合约 TS1903 收报 100.135，较上个交易日上涨 0.03%。现券市场早盘小幅低开，收益率全天一路走低。截至目前，剩余期限 9.57 年的国开债活跃券 180210 收益率报 3.675%/3.6725%，剩余期限 9.68 年的国债活跃券 180019 收益率报 3.27%/3.265%。

周一人民币兑美元中间价报 6.8693，较上个交易日下调 29 点。在岸人民币兑美元全天一路下行，午后跌幅扩大，截至 16:30，在岸人民币兑美元收报 6.9135，较上一交易日官方收盘价收跌 337 点；离岸人民币兑美元早盘探底回升，午后震荡下跌，现报 6.9144，较上一交易日下跌 281 点，目前两岸汇差在 9 点附近。美元指数早盘跳水，随后全天震荡回升，现报 96.64，较上一交易日下跌 0.12%。

上周五（12 月 7 日）CFETS 人民币汇率指数录得 93.18，按周上行 0.99；参考 BIS 货币篮子的人民币汇率指数录得 96.92，按周上行 1.04，参考 SDR 货币篮子的人民币汇率指数录得 93.31，按周上行 0.92。

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