

# 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

【2019-12-12】

今日央行发公告称，目前银行体系流动性总量处于合理充裕水平，可吸收政府债券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 利率短端下跌，长端上行，其中隔夜品种报 2.0530%，较上个交易日下跌 2.80 个基点；7 天品种报 2.4310%，较上个交易日下跌 6.20 个基点；1 个月品种报 2.8910%，较上个交易日上涨 2.00 个基点；3 个月品种报 3.0305%，较上个交易日上涨 0.05 个基点。今日年内各期限资金呈现宽松态势，各类型机构均有融出；21 天期限需求较多；1 个月及以上整体表现均衡，需求均能得到满足。

今日发行的 1 年期、3 年期、5 年期、10 年期进出口行固息增发债中标利率分别为 2.5956%、2.9827%、3.3037%、3.6825%，全场倍数分别为 3.22 倍、3.86 倍、3.56 倍、3.50 倍，边际倍数分别为 40.00 倍、2.14 倍、2.60 倍、1.68 倍。国债期货早盘冲高回落，午后再次震荡上行。10 年期国债期货主力合约 T2003 收报 97.955，较上个交易日上涨 0.05%；5 年期国债期货主力合约 TF2003 收报 99.720，较上个交易日上涨 0.04%；2 年期国债期货主力合约 TS2003 收报 100.265，较上个交易日上涨 0.01%。今日现券收益率窄幅震荡。截至目前，剩余期限 9.77 年的国开债活跃券 190215 收益率报 3.5750%/3.5725%，剩余期限 9.45 年的国债活跃券 190006 收益率报 3.1875%/3.1825%。

周四人民币兑美元中间报价 7.0253，较上个交易日上调 132 点。在岸人民币兑美元早盘高开，随后全天维持震荡，截至 16:30，在岸人民币兑美元收报 7.0333，较上个交易日官方收盘价上涨 53 点。离岸人民币兑美元早盘冲高回落，午后震荡走弱，现报 7.0329，较上个交易日收盘价下跌 49 点，目前两岸汇差倒挂在 4 点附近。美元指数全天探底回升，现报 97.10，较上个交易日下跌 0.06%。

以上仅供参考，谢谢！

文/Dshlin Dong

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**