



【2018-09-28】

今日央行发布公告称，考虑到季末财政支出推动银行体系流动性总量处于较高水平，可吸收央行逆回购到期、政府债券发行缴款等因素的影响，不开展公开市场操作，逆回购到期 400 亿元，资金净回笼 400 亿元。Shibor 利率除隔夜外全数上涨，其中隔夜品种报 2.4450%，下跌 1.50 个基点；7 天品种报 2.7300%，上涨 0.80 个基点；1 个月品种报 2.8000%，上涨 0.10 个基点；3 个月品种报 2.8430%，上涨 0.50 个基点。今日资金面呈现月内期限宽松、跨季期限紧张态势，早盘大行大量减点融出隔夜，7 天至 14 天跨季资金融出有限、需求较多，午后隔夜资金依旧宽松，7 天至 14 天期限紧张态势有所缓和，价格略有下降。整体来看，跨季资金操作主要集中于非银。

国债期货早盘小幅高开，随后横盘震荡，午后拉升走高，尾盘小幅回落。10 年期国债期货主力合约 T1812 收报 94.785，较上个交易日上涨 0.13%；5 年期国债期货主力合约 TF1812 收报 97.760，较上个交易日上涨 0.06%；2 年期国债期货主力合约 TS1812 收报 99.390，较上个交易日上涨 0.01%。流动性平稳跨季基本无忧，国庆长假在即，部分非银机构已进入休假状态，债券市场交投清淡，现券收益率小幅震荡，略有下行。截至目前，剩余期限 9.77 年的国开债活跃券 180210 收益率报 4.20%/4.195%，剩余期限 9.88 年的国债活跃券 180019 收益率报 3.62%/3.61%。

周五人民币兑美元中间价报 6.8792，较上个交易日下调 150 点。在岸人民币兑美元全天维持震荡，临近尾盘直线拉升，随后回吐全部涨幅，截至 16:30，在岸人民币兑美元收报 6.8814，较上一个交易日下跌 44 点；离岸人民币兑美元全天持续震荡偏强，现报 6.8793，较上个交易日上涨 86 点，两岸汇差目前倒挂在 50 点附近。美元指数早盘平稳，午后小幅上行，现报 95.13，较上一个交易日上涨 0.15%。

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