

# 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

**【2018-10-17】**

今日央行发布公告称，目前银行体系流动性总量处于较高水平，可吸收政府债券发行缴款等因素的影响，不开展公开市场操作，今日无逆回购到期，资金零投放零回笼。Shibor 利率整体短端下行、长端上行，其中隔夜品种报 2.3530%，下跌 2.00 个基点；7 天品种报 2.6040%，上涨 0.10 个基点；1 个月品种报 2.6510%，下跌 0.70 个基点；3 个月品种报 2.8180%，上涨 1.80 个基点。今日资金面较昨日略有收敛，但总体仍保持宽松态势，大行减点融出隔夜，7 天及以上需求有限。

央行公布数据显示，中国 9 月 M2 同比增 8.3%，新增人民币贷款 13800 亿人民币，社会融资规模 22100 亿人民币，均超预期和前值。央行表示，今年 8 月份以来，地方政府专项债券发行进度加快，对银行贷款、企业债券等有明显的接替效应，为将该接替效应返还到社会融资规模中，9 月起，将“地方政府专项债券”纳入社会融资规模统计。

今日发行的 2 年期、5 年期附息国债加权中标利率分别为 3%、3.29%，边际利率分别为 3.12%、3.37%，全场倍数分别为 2.11 倍、2.42 倍，边际倍数分别为 1.24 倍、1.94 倍。国债期货早盘窄幅震荡，午后冲高回落，小幅收跌。10 年期国债期货主力合约 T1812 收报 95.165，较上个交易日下跌 0.01%；5 年期国债期货主力合约 TF1812 收报 98.010，较上个交易日下跌 0.02%；2 年期国债期货主力合约 TS1812 收报 99.520，较上个交易日持平。今日资金维持宽松，债券市场窄幅波动，午后现券收益率在金融数据公布后一度上行，随后逐渐回落。截至目前，剩余期限 9.72 年的国开债活跃券 180210 收益率报 4.145%/4.1425%，剩余期限 9.83 年的国债活跃券 180019 收益率报 3.59%/3.56%。

周三人民币兑美元中间价报 6.9103，较上个交易日上调 16 点。在岸人民币兑美元早盘探底回升，午后震荡下行，跌幅扩大，截至 16:30，在岸人民币兑美元收报 6.9249，较上一个交易日官方收盘价下跌 63 点；离岸人民币兑美元早盘下跌，午后震荡回升，收复部分失地，现报 6.9197，较上个交易日下跌 65 点，两岸汇差目前倒挂在 60 点附近。美元指数早盘一路上行，午后小幅跳水后反弹回升，现报 95.17，较上一个交易日上涨 0.10%。

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**