



【2018-11-02】

央行公告显示，目前银行体系流动性总量处于合理充裕水平，今日不开展逆回购操作，亦无逆回购到期，资金零投放零回笼，本周累计有 4900 亿元逆回购到期，净回笼 4900 亿元。Shibor 利率涨跌互现，其中隔夜品种报 2.4770%，下跌 7.00 个基点；7 天品种报 2.6490%，下跌 2.40 个基点；1 个月品种报 2.6940%，下跌 0.20 个基点；3 个月品种报 2.9810%，上涨 0.50 个基点。今日资金面维持宽松态势，早盘大行均价融出隔夜资金，机构需求基本可以得到满足，午后有减点隔夜融出，7 天、14 天资金融出较多，需求较少。

今日发行的 91 天期贴现国债加权中标收益率为 2.3193%，边际中标收益率为 2.4861%，全场倍数为 1.93 倍，边际倍数为 1.90 倍。国债期货早盘大幅低开，随后窄幅震荡，午后开盘直线跳水，大幅收跌。10 年期国债期货主力合约 T1812 收报 95.500，较上个交易日大幅下跌 0.47%；5 年期国债期货主力合约 TF1812 收报 98.130，较上个交易日大幅下跌 0.27%；2 年期国债期货主力合约 TS1812 收报 99.610，较上个交易日下跌 0.03%。受国家主席主持召开民营企业座谈会、中美贸易摩擦迎来转机等因素影响，今日市场风险偏好回升，股市大幅走强，债市承压调整，现券收益率早盘高开后全天上行，十年国开收益率较昨日收盘上行约 6BP。截至目前，剩余期限 9.67 年的国开债活跃券 180210 收益率报 4.1175%/4.1125%，剩余期限 9.79 年的国债活跃券 180019 收益率报 3.58%/3.53%。

周五人民币兑美元中间价报 6.9371，较上个交易日大幅上调 299 点。在岸人民币兑美元早盘走强后维持横盘整理，午后进一步强势，涨幅扩大，接连收复 6.92、6.91、6.90、6.89 关口，截至 16:30，在岸人民币兑美元收报 6.8897，较上一个交易日官方收盘价大幅上涨 599 点；离岸人民币兑美元早盘回吐部分昨日涨幅，午后直线走强，并收复 6.89 关口，现报 6.8843，较上个交易日上涨 327 点；目前两岸汇差倒挂在 60 点附近。美元指数全天震荡下行，现报 96.09，较上一个交易日下跌 0.20%。

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