

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

【2018-09-13】

今日央行公开市场进行 1000 亿元 7 年期、200 亿元 14 天期逆回购操作，无逆回购操作，资金净投放 1200 亿。Shibor 利率涨跌互现，其中隔夜品种报 2.5300%，下跌 2.70 个基点；7 天品种报 2.6630%，下跌 1.20 个基点；1 个月品种报 2.7600%，上涨 0.90 个基点；3 个月品种报 2.8430%，下跌 0.30 个基点。央行连续第二日资金净投放，今日资金面整体宽松，早盘隔夜减点融出，14 天需求减少，1 个月成交价格下降，午后资金面依旧宽松，持续至尾盘。

今日发行的 1 年期、3 年期、5 年期进出口行固息增发债中标利率分别为 3.0000%、3.7800%、4.1132%，全场倍数分别为 3.91 倍、3.37 倍、2.44 倍，边际倍数分别为 1.08 倍、3.25 倍、10.33 倍。下午发行的 7 年期、10 年期国开行固息增发债中标利率分别为 4.2999% 和 4.2218%，全场倍数分别为 2.91 倍、3.39 倍，边际倍数分别为 1.06 倍、11.49 倍。

国债期货早盘小幅低开，随后震荡走升，尾盘稍有回落。10 年期国债期货主力合约 T1812 收报 94.370，较上个交易日上涨 0.05%；5 年期国债期货主力合约 TF1812 收报 97.490，较上个交易日上涨 0.06%；2 年期国债期货主力合约 TS1812 收报 99.270，较上个交易日上涨 0.03%。今日资金面继续缓和，国债期货小幅收涨，现券收益率窄幅震荡，略有上行。截至目前，剩余期限 9.81 年的国开债活跃券 180210 收益率报 4.2475%/4.245%，剩余期限 9.67 年的国债活跃券 180011 收益率报 3.67%/3.635%。

周四人民币兑美元中间价报 6.8488，较上个交易日上调 58 个基点。在岸人民币兑美元早盘直线走强后小幅回落，随后横盘整理，截至 16:30，在岸人民币兑美元收报 6.8487，较上一个交易日上涨 193 点；离岸人民币兑美元全天震荡偏弱，现报 6.8462，较上个交易日下跌 104 点，两岸汇差倒挂在 25 点。美元指数早盘震荡，午后小幅上行，现报 94.93，上涨 0.12%。

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