

# 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

**【2018-10-16】**

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，可吸收中央国库现金管理到期等因素的影响，不开展公开市场操作，今日无逆回购到期，国库现金定存到期 1500 亿元，资金净回笼 1500 亿元。Shibor 利率整体下跌，其中隔夜品种报 2.3730%，下跌 0.40 个基点；7 天品种报 2.6030%，下跌 0.90 个基点；1 个月品种报 2.6580%，下跌 1.00 个基点；3 个月品种报 2.8000%，下跌 0.10 个基点。今日资金面较昨日类似，维持宽松态势，早盘大行减点融出隔夜资金，7 天及以上期限供大于求，午后隔夜加权融出，需求均可满足。

国家统计局今早公布数据显示，中国 9 月 CPI 同比上涨 2.5%，创 7 个月新高，持平于预期的 2.5%，前值为 2.3%，连续第三个月处于 2 之上；9 月 PPI 同比升 3.6%，刷新 5 个月新低，略高于预期的 3.5%，前值为 4.1%。从环比看，CPI 环比上涨 0.7%，涨幅与上月相同，PPI 环比上涨 0.6%，环比涨幅有所扩大。

今日发行的 3 年期、5 年期、7 年期、10 年期国开行固息增发债中标利率分别为 3.5418%、3.8477%、4.1643%、4.1435%，全场倍数分别为 2.92 倍、3.26 倍、3.28 倍、2.66 倍，边际倍数分别为 2.24 倍、3.24 倍、3.43 倍、1.83 倍。国债期货早盘小幅低开，随后维持弱势震荡，午后触底反弹，由跌转涨。10 年期国债期货主力合约 T1812 收报 95.235，较上个交易日上涨 0.21%；5 年期国债期货主力合约 TF1812 收报 98.070，较上个交易日上涨 0.06%；2 年期国债期货主力合约 TS1812 收报 99.535，较上个交易日上涨 0.03%。尽管今日公布的 CPI 创 7 个月新高，但 PPI 同比刷新 5 个月新低，同时股市持续调整，避险情绪提升，现券收益率早盘小幅高开，午后加速下行，10 年期国开收益率下行约 2.5BP。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%/4.14%，剩余期限 9.83 年的国债活跃券 180019 收益率报 3.575%/3.57%。

周二人民币兑美元中间价报 6.9119，较上个交易日上调 35 点。在岸、离岸人民币兑美元早盘走强后持续回吐涨幅，午间横盘整理，临近尾盘震荡回升，截至 16:30，在岸人民币兑美元收报 6.9186，较上一个交易日官方收盘价上涨 84 点；离岸人民币兑美元现报 6.9140，较上个交易日上涨 89 点，两岸汇差目前倒挂在 40 点附近。美元指数早盘一路上行，午后跳水翻绿，现报 95.07，较上一个交易日下跌 0.01%。

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**