

# 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

【2018-09-14】

周五央行公开市场进行 1100 亿元 7 天期、400 亿元 14 天期逆回购操作，无逆回购到期，国库现金定存到期 1000 亿元，资金净投放 500 亿元。Shibor 利率短端下跌，长端上涨，其中隔夜品种报 2.4890%，下跌 4.10 个基点；7 天品种报 2.6450%，下跌 1.80 个基点；1 个月品种报 2.7560%，下跌 0.40 个基点；3 个月品种报 2.8300%，下跌 1.30 个基点。今日资金面整体宽松，早盘各期限资金均有融出，其中隔夜减点融出，午后资金面趋于均衡，部分机构有隔夜融入需求，融出减少，价格上行，成交在加权位置，长期限资金成交有限。

国家统计局公布数据显示，中国 8 月经济数据喜忧参半，其中，8 月规模以上工业增加值同比增速反弹至 6.1%，符合预期，高于前值的 6%，8 月社会消费品零售总额同比小幅回升至 9%，超预期和前值，但 1-8 月固定资产投资增速较 1-7 月仍旧回落 0.2 个百分点，房地产开发投资增速小幅回落，较 1-7 月回落 0.1 个百分点。

今日财政部新发的 91 天期贴现国债加权利率为 2.1209%，边际利率为 2.1534%，全场倍数为 2.56 倍，边际倍数为 2.45 倍；30 年期续发的附息国债中标利率为 4.2285%，全场倍数为 2.33 倍，边际倍数为 1.30 倍。国债期货早盘低开，随后冲高回落，午后震荡上行，尾盘收涨。10 年期国债期货主力合约 T1812 收报 94.485，较上个交易日上涨 0.10%；5 年期国债期货主力合约 TF1812 收报 97.570，较上个交易日上涨 0.06%；2 年期国债期货主力合约 TS1812 收报 99.300，较上个交易日上涨 0.02%。今日资金面继续缓和，叠加国内经济喜忧参半，国债期货小幅收涨，现券收益率小幅下行。截至目前，剩余期限 9.81 年的国开债活跃券 180210 收益率报 4.235%/4.23%，剩余期限 9.67 年的国债活跃券 180011 收益率报 3.67%/3.635%。

周五人民币兑美元中间价报 6.8362，较上个交易日上调 126 点。在岸人民币兑美元早盘震荡下行，午后冲高后再度回落，截至 16:30，在岸人民币兑美元收报 6.8521，较上一个交易日下跌 34 点；离岸人民币兑美元早盘一路下行，午后回升后再度下跌，现报 6.8467，较上个交易日下跌 19 点，两岸汇差倒挂在 63 点。美元指数早盘震荡，午后一路下行，现报 94.48，下挫 0.07%。

以上仅供参考，谢谢！

文/Vivian Shen

如果您对本文有任何评论与见解  
请发电邮至：[SHResearch@cfets-nex.com.cn](mailto: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**