

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

【2018-10-09】

央行今日发布公告称，目前银行体系流动性总量处于较高水平，可吸收央行逆回购到期等因素的影响，不开展公开市场操作，逆回购到期 600 亿元，资金净回笼 600 亿元。Shibor 利率全数下跌，其中隔夜品种报 2.5020%，下跌 3.40 个基点；7 天品种报 2.6330%，下跌 2.40 个基点；1 个月品种报 2.7340%，下跌 4.70 个基点；3 个月品种报 2.8160%，下跌 2.00 个基点。今日资金面较昨日宽松，早盘大行减点融出隔夜，7 天资金融出较多，需求可得到满足，价格较昨日下降，更长期限成交有限，月内期限总体宽松，午后资金面延续宽松状态至尾盘。

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 3.5758%、3.8795%、4.2258%、4.1554%，全场倍数分别为 3.32 倍、3.37 倍、3.1 倍、2.36 倍，边际倍数分别为 2.63 倍、1.02 倍、2.27 倍、2.36 倍。国债期货早盘短暂触底后大幅走高，随后震荡回落，尾盘再度走升。10 年期国债期货主力合约 T1812 收报 94.770，较上个交易日上涨 0.09%；5 年期国债期货主力合约 TF1812 收报 97.810，较上个交易日上涨 0.07%；2 年期国债期货主力合约 TS1812 收报 99.455，较上个交易日上涨 0.06%。节后资金面维持宽松，债券市场维持胶着，短端收益率略有下行，长端收益率小幅震荡。截至目前，剩余期限 9.74 年的国开债活跃券 180210 收益率报 4.1875%/4.185%，剩余期限 9.85 年的国债活跃券 180019 收益率报 3.62%/3.6125%。

周二人民币兑美元中间价报 6.9019，较上个交易日下调 62 点。在岸、离岸人民币兑美元早盘一路上行，午后下跌，回吐全部涨幅，截至 16:30，在岸人民币兑美元收报 6.9235，较上一个交易日官方收盘价下跌 100 点；离岸人民币兑美元现报 6.9264，较上个交易日下挫 71 点，两岸汇差目前在 45 点附近。美元指数早盘维持横盘整理态势，午后小幅下探后大幅拉升，现报 95.88，较上一个交易日上涨 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