

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

【2018-10-22】

今日央行公开市场进行 1200 亿元 7 天期逆回购操作，无逆回购到期，资金净投放 1200 亿元。Shibor 利率全数上涨，其中隔夜品种报 2.4750%，上涨 3.00 个基点；7 天品种报 2.6320%，上涨 1.00 个基点；1 个月品种报 2.6630%，上涨 0.80 个基点；3 个月品种报 2.8710%，上涨 2.90 个基点。今日资金面仍维持宽松状态，早盘隔夜减点融出较上个交易日减少，大行多加权融出，7 天、14 天成交价格与上个交易日相近，午后隔夜以加权融出为主，资金面变化不大。

国债期货早盘低开后维持横盘整理态势，午后小幅冲高，跌幅收窄，尾盘再度回落，全线收跌。10 年期国债期货主力合约 T1812 收报 95.150，较上个交易日下跌 0.10%；5 年期国债期货主力合约 TF1812 收报 97.975，较上个交易日下跌 0.08%；2 年期国债期货主力合约 TS1812 收报 99.440，较上个交易日下跌 0.05%。上周监管层密发声以及周末减税等消息刺激，今日股市大幅上涨，压制债市情绪，现券收益率早盘小幅高开，随后窄幅震荡。截至目前，剩余期限 9.70 年的国开债活跃券 180210 收益率报 4.145%/4.1425%，剩余期限 9.82 年的国债活跃券 180019 收益率报--%/3.585%。

周一人民币兑美元中间价报 6.9236，较上个交易日上调 151 点。在岸人民币兑美元早盘小幅震荡上行，午后直线走弱，跌幅不断扩大，截至 16:30，在岸人民币兑美元收报 6.9372，较上一个交易日官方收盘价下跌 51 点；离岸人民币兑美元早盘一路上涨，午后跳水下挫，回吐全部涨幅，现报 6.9427，较上个交易日下跌 80 点，两岸汇差目前在 60 点附近。美元指数全天下跌，午后跌幅扩大，随后直线拉升，小幅翻红，现报 95.68，较上一个交易日上涨 0.01%。

上周五（10 月 19 日）CFETS 人民币汇率指数录得 92.15，按周下行 0.23；参考 BIS 货币篮子的人民币汇率指数录得 95.74，按周下行 0.23，参考 SDR 货币篮子的人民币汇率指数录得 91.88，按周上行 0.08。

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