



【2018-10-12】

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，不开展公开市场操作，无逆回购到期，资金零投放零回笼。Shibor 利率短端上涨、长端下跌，其中隔夜品种报 2.4390%，上涨 7.90 个基点；7 天品种报 2.6150%，上涨 0.40 个基点；1 个月品种报 2.6820%，下跌 1.00 个基点；3 个月品种报 2.8000%，下跌 0.10 个基点。今日资金面总体延续宽松态势，早盘大行减点融出隔夜、需求有限，7 天、14 天期限总体供大于求，更长期限成交较少，午后隔夜加权融出，且融出有所减少，临近尾盘部分银行有较大补头寸需求，导致资金面略有收紧，但总体宽松趋势不改，需求均可满足。

海关总署今早发布数据显示，中国 9 月进口同比(按美元计)14.3%，低于预期的 15.3%，前值为 20%；9 月出口同比(按美元计)14.5%，大幅好于预期的 8.2%，前值为 9.8%；贸易帐顺差为 316.9 亿美元，预期顺差为 192 亿美元，前值顺差为 278.9 亿美元。

财政部今日发行的 91 天期、182 天期贴现国债中标利率分别为 1.9269%、2.2398%，边际利率分别为 2.0561%、2.3783%，全场倍数分别为 1.87 倍、2.16 倍，边际倍数分别为 3.67 倍、3.29 倍。国债期货早盘短暂触底后冲高走强，进出口数据出炉后震荡小幅收跌，临近午盘回吐大部分涨幅，午后维持弱势震荡。10 年期国债期货主力合约 T1812 收报 95.120，较上个交易日下跌 0.04%；5 年期国债期货主力合约 TF1812 收报 98.050，较上个交易日下跌 0.01%；2 年期国债期货主力合约 TS1812 收报 99.525，较上个交易日上涨 0.02%。今日银行间市场资金面维持宽松态势，9 月进出口数据超预期，现券收益率全天窄幅波动，变化不大。截至目前，剩余期限 9.73 年的国开债活跃券 180210 收益率报 4.1575%/4.1525%，剩余期限 9.84 年的国债活跃券 180019 收益率报 3.59%/3.58%。

周五人民币兑美元中间价报 6.9120，较上个交易日下调 22 点。在岸人民币兑美元早盘走强后维持横盘整理态势，午后一路下行，回落逾 200 点，涨幅明显收窄，截至 16:30，在岸人民币兑美元收报 6.9234，较上一个交易日官方收盘价上涨 34 点；离岸人民币兑美元全天一路下跌，现报 6.9182，较上个交易日大幅下挫 396 点，两岸汇差目前倒挂在 50 点附近。美元指数全天维持弱势震荡，现报 95.06，较上一个交易日上涨 0.03%。

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