



【2018-10-18】

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，可吸收税期、政府债券发行缴款等因素的影响，不开展公开市场操作，今日无逆回购到期，资金零投放零回笼。Shibor 利率多数上涨，其中隔夜品种报 2.4270%，上涨 7.40 个基点；7 天品种报 2.6110%，上涨 0.70 个基点；1 个月品种报 2.6510%，较上个交易日持平；3 个月品种报 2.8320%，上涨 1.40 个基点。今日资金面维持宽松状态，早盘隔夜较昨日略有收紧，但总体仍保持宽松，7 天、14 天以融出为主，午后隔夜融出有所减少，宽松延续至尾盘。

今日发行的 1 年期、3 年期进出口行固息增发债中标利率分别为 2.8175%、3.5723%，全场倍数分别为 2.95 倍、3.67 倍，边际倍数分别为 2.06 倍、1.53 倍。国债期货早盘小幅高开，随后震荡走升。10 年期国债期货主力合约 T1812 收报 95.490，较上个交易日上涨 0.36%；5 年期国债期货主力合约 TF1812 收报 98.125，较上个交易日上涨 0.10%；2 年期国债期货主力合约 TS1812 收报 99.535，较上个交易日上涨 0.02%。今日资金维持宽松，国债期货全日震荡走高，长端现券收益率显著下行。截至目前，剩余期限 9.72 年的国开债活跃券 180210 收益率报 4.105%/4.10%，剩余期限 9.83 年的国债活跃券 180019 收益率报 3.5475%/--%。

周四人民币兑美元中间价报 6.9275，较上个交易日下调 172 点。在岸人民币兑美元早盘直线下挫，随后小幅上行，午后跌幅扩大，截至 16:30，在岸人民币兑美元收报 6.9409，较上一个交易日官方收盘价下跌 160 点；离岸人民币兑美元全天震荡下行，现报 6.9395，较上个交易日下跌 91 点，两岸汇差目前在 23 点附近。美元指数早盘一路上行，午后大幅跳水，现报 95.50，较上一个交易日下跌 0.14%。央行午后公布数据显示，中国 9 月外汇占款余额减少 1,193.95 亿元人民币，至 21.4 万亿元，降幅为 2017 年 1 月以来最大；上月降幅 23.95 亿元。

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