



【2018-10-08】

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，可吸收央行逆回购到期、金融机构缴存法定存款准备金等因素的影响，不开展公开市场操作，逆回购到期 1000 亿元，资金净回笼 1000 亿元。Shibor 利率全数下跌，其中隔夜品种报 2.5360%，下跌 11.70 个基点；7 天品种报 2.6570%，下跌 10.90 个基点；1 个月品种报 2.7810%，下跌 2.10 个基点；3 个月品种报 2.8360%，下跌 1.10 个基点。今日资金面总体宽松，各期限资金均有融出，早盘机构加权融出隔夜至 7 天资金，午后有大行减点融出，14 天及以上期限部分机构融出，需求有限，银存间质押式回购利率全线走低。

国债期货早盘大幅走低，随后逐渐企稳，午后跌幅收窄。10 年期国债期货主力合约 T1812 收报 94.675，较上个交易日下跌 0.14%；5 年期国债期货主力合约 TF1812 收报 97.735，较上个交易日下跌 0.06%；2 年期国债期货主力合约 TS1812 收报 99.385，较上个交易日下跌 0.01%。国庆假期期间，美债收益率大幅走升，中美利差收窄，不过节后资金面宽松，央行通过降准释放流动性，债券市场维持震荡，现券收益率较节前略有下行。截至目前，剩余期限 9.74 年的国开债活跃券 180210 收益率报 4.185%/4.18%，剩余期限 9.85 年的国债活跃券 180019 收益率报 3.625%/3.61%。

周一人民币兑美元中间价报 6.8957，较上个交易日下调 165 点。在岸人民币兑美元全天走弱后维持横盘震荡，临近尾盘跌幅扩大，截至 16:30，在岸人民币兑美元收报 6.9135，较上一个交易日大幅下跌 321 点，创 2017 年 3 月 10 日以来新低；离岸人民币兑美元全天震荡下行，午后直线走弱，连续跌破多个关口，现报 6.9330，较上个交易日下挫 382 点，两岸汇差目前在 80 点附近。美元指数全天一路上行，不断逼近 96 整数关口，现报 95.91，较上一个交易日上涨 0.27%。

9 月 28 日，CFETS 人民币汇率指数录得 92.35，按周下行 0.31；参考 BIS 货币篮子的人民币汇率指数录得 96.01，按周下行 0.27，参考 SDR 货币篮子的人民币汇率指数录得 92.23，按周下行 0.02。

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