



【2018-11-15】

今日央行发布公告称，受税期、中央国库现金管理到期等因素影响，银行体系流动性总量有所下降，但仍处于合理充裕水平，不开展逆回购操作，今日无逆回购到期，国库现金定存到期 1200 亿，资金净回笼 1200 亿元。Shibor 利率涨跌互现，其中隔夜品种报 2.3390%，上涨 1.40 个基点；7 天品种报 2.6290%，下跌 0.30 个基点；1 个月品种报 2.6850%，较上个交易日持平；3 个月品种报 3.0100%，上涨 0.20 个基点。今日资金面依旧宽松，早盘大行融出隔夜，融入需求有限，需求较快满足，午后间或有中小机构补头寸，需求较快满足，资金面维持宽松状态，7 天及以上期限以融出为主，融入需求有限，部分机构有跨年资金需求，但成交不多。

今日发行的 1 年期、3 年期、5 年期、10 年期进出口行固息增发债中标利率分别为 2.5815%、3.3904%、3.643%、3.9908%，全场倍数分别为 3.32 倍、3.42 倍、3.5 倍、3.72 倍，边际倍数分别为 22 倍、5.83 倍、2.45 倍、1.36 倍。下午发行的 5 年期、10 年期国开行固息增发债中标利率分别为 3.5887%、3.9142%，全场倍数分别为 2.72 倍、3.56 倍，边际倍数分别为 3.89 倍、2 倍。国债期货早盘低开后短暂走低，随后全天震荡上行。10 年期国债期货主力合约 T1812 收报 96.560，较上个交易日上涨 0.09%；5 年期国债期货主力合约 TF1812 收报 98.730，较上个交易日上涨 0.06%；2 年期国债期货主力合约 TS1812 收报 100.055，较上个交易日持平。今日现券收益率早盘震荡，午后明显下行。截至目前，剩余期限 9.64 年的国开债活跃券 180210 收益率报 3.945%/3.94%，剩余期限 9.75 年的国债活跃券 180019 收益率报 3.395 %/--%。

周四人民币兑美元中间价报 6.9392，较上个交易日上调 10 点。在岸、离岸人民币兑美元全天均一路上行，截至 16:30，在岸人民币兑美元收报 6.9359，较上一个交易日官方收盘价上涨 150 点，离岸人民币兑美元现报 6.9284，较上一交易日上涨 153 点，目前两岸汇差倒挂在 75 点附近。美元指数全天震荡下行，现报 96.84，较上一交易日下跌 0.21%。

以上仅供参考，谢谢！

文/Ellen Liu

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