

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

【2018-09-21】

今日央行发布公告称，考虑到月末财政支出、中央国库现金管理操作可对冲政府债券发行缴款、央行逆回购到期等因素的影响，为维护银行体系流动性合理充裕，不开展公开市场操作，今日开展国库现金定存 1200 亿元，中标利率由前次的 3.80% 下降至 3.71%，逆回购到期 1100 亿元，资金净投放 100 亿元。Shibor 利率短端下跌、长端上涨，其中隔夜品种报 2.5140%，下跌 0.50 个基点；7 天品种报 2.6540%，下跌 0.50 个基点；1 个月品种报 2.7540%，上涨 0.10 个基点；3 个月品种报 2.8150%，上涨 0.30 个基点。今日资金面整体较昨日宽松，早盘隔夜资金大量融出，午后融出有所减少，但融入需求亦有限，需求可得到满足，其他期限方面，跨季、跨月资金融出均较多，价格水平不高，资金面总体处于均衡状态。

今日发行的 91 天期贴现国债中标利率分别为 2.0735%，边际利率为 2.1209%，全场倍数分别为 2.77 倍，边际倍数分别为 1.21 倍。国债期货早盘低开高走，临近午盘涨幅收窄，午后探底回升，尾盘涨幅扩大。10 年期国债期货主力合约 T1812 收报 94.185，较上个交易日上涨 0.20%；5 年期国债期货主力合约 TF1812 收报 97.410，较上个交易日上涨 0.13%；2 年期国债期货主力合约 TS1812 收报 99.320，较上个交易日上涨 0.04%。今日资金面整体均衡偏松，国债期货连续大跌后反弹，现券收益率先上后下。截至目前，剩余期限 9.79 年的国开债活跃券 180210 收益率报 4.27%/4.265%，剩余期限 9.65 年的国债活跃券 180011 收益率报 3.70%/3.675%。

周五人民币兑美元中间价报 6.8357，较上个交易日上调 173 点。在岸人民币兑美元早盘高开，随后涨幅有所收窄，午后再度走强，临近尾盘小幅回落，截至 16:30，在岸人民币兑美元收报 6.8390，较上一个交易日上涨 138 点；离岸人民币兑美元全天维持震荡，临近尾盘有所回落，现报 6.8341，较上个交易日上涨 15 点，两岸汇差目前倒挂在 60 附近波动。美元指数全天弱势震荡，午后振幅加大，现报 93.92，较上一个交易日上涨 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