

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

【2018-09-25】

今日央行公开市场开展 600 亿元 14 天期逆回购操作，逆回购到期 1500 亿元，资金净回笼 900 亿元。Shibor 利率全线上涨，其中隔夜品种报 2.5430%，上涨 2.90 个基点；7 天品种报 2.6920%，上涨 3.80 个基点；1 个月品种报 2.7710%，上涨 1.70 个基点；3 个月品种报 2.8270%，上涨 1.20 个基点。今日资金面较上周有所收敛，早盘大行融出加权隔夜资金，临近午盘，隔夜资金融出有所减少，午后部分大行开始回补头寸，尾盘资金面再度趋于均衡。

国债期货早盘小幅高开，短暂触底后拉升走高，午后维持横盘整理态势。10 年期国债期货主力合约 T1812 收报 94.210，较上个交易日上涨 0.07%；5 年期国债期货主力合约 TF1812 收报 97.425，较上个交易日上涨 0.04%；2 年期国债期货主力合约 TS1812 收报 99.295，较上个交易日下跌 0.01%。今日资金面有所收敛，美联储加息在即，现券收益率全天窄幅震荡，变化不大。截至目前，剩余期限 9.78 年的国开债活跃券 180210 收益率报 4.2675%/4.265%，剩余期限 9.64 年的国开债活跃券 180011 收益率报 4.367%。

周二人民币兑美元中间价报 6.8440，较上个交易日下调 83 点。在岸人民币兑美元早盘下行，午盘震荡偏弱，午后跌幅增大，截至 16:30，在岸人民币兑美元收报 6.8770，较上一个交易日大幅下跌 380 点；离岸人民币兑美元全天维持震荡，16:00 后直线下挫百余点，现报 6.8715，较上个交易日下跌 27 点，两岸汇差目前倒挂在 80 点附近。美元指数早盘上行，午后下探，16:00 后直线拉升，现报 94.23，较上一个交易日下跌 0.04%。

上周五（9 月 21 日）CFETS 人民币汇率指数录得 92.66，按周下行 0.39；参考 BIS 货币篮子的人民币汇率指数录得 96.28，按周下行 0.39，参考 SDR 货币篮子的人民币汇率指数录得 92.25，按周下行 0.30。

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