市场概述
每日市场动态

常规报告系列

上海国际货币经纪
Shanghai CFETS-NEX International Money Broking

【2018-10-23】

央行今日公开市场进行 1200 亿元 7 天期逆回购操作，无逆回购到期，资金净投放 1200 亿元。Shibor 利率除隔夜外全数上涨，其中隔夜品种报 2.4510%，下跌 2.40 个基点；7 天品种报 2.6350%，上涨 0.30 个基点；1 个月品种报 2.6720%，上涨 0.90 个基点；3 个月品种报 2.9030%，上涨 3.20 个基点。今日资金面整体宽松，早盘大行减点融出隔夜，需求较快满足，14 天及以上跨月期限价格较昨日稍高，融出较多，午后隔夜融出以加权为主，资金面总体变化不大。

今日发行的 3 年期、5 年期、7 年期、10 年期国开行固息增发债中标利率分别为 3.5258%、3.8391%、4.15%、4.1039%，全场倍数分别为 3.89 倍、4.29 倍、3.28 倍、3.36 倍，边际倍数分别为 1.07 倍、3.3 倍、1.93 倍、1.2 倍。国债期货小幅低开，随后震荡走升，午后涨幅扩大。10 年期国债期货主力合约 T1812 收报 95.330，较上个交易日上涨 0.22%； 5 年期国债期货主力合约 TF1812 收报 98.085，较上个交易日上涨 0.10%；2 年期国债期货主力合约 TS1812 收报 99.485，较上个交易日上涨 0.05%。今日资金面继续维持偏松态势，A 股在连续两日大涨后回落调整，债券市场小幅走强，现券收益率早盘明显高开，随后震荡走低，十年国开较昨日尾盘下行近 2BP。截至目前，剩余期限 9.70 年的国开债活跃券 180210 收益率报 4.13%/4.12%，剩余期限 9.81 年的国债活跃券 180019 收益率报 3.5725%/3.565%。

周二人民币兑美元中间价报 6.9338，较上个交易日下调 102 点。在岸人民币兑美元早盘高开后震荡偏弱，午后一路上行，收复绝大部分失地，截至 16:30，在岸人民币兑美元收报 6.9374，较上一个交易日官方收盘价微跌 2 点；离岸人民币兑美元早盘下行，午后震荡回升，现报 6.9452，较上个交易日下跌 75 点，两岸汇差目前在 80 点附近。美元指数早盘维持在 96 关口附近震荡，午后冲高回落，现报 95.94，较上一个交易日下跌 0.09%。

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。