



【2018-10-15】

今日央行发布公告称，2018 年 10 月 15 日中国人民银行下调大型商业银行、股份制商业银行、城市商业银行、非县域农村商业银行、外资银行人民币存款准备金率 1 个百分点，顺延至今日到期的 4515 亿中期借贷便利（MLF）不再续做，此外，央行今日不开展逆回购操作，今日亦无逆回购到期。Shibor 利率整体短端下行、长端上行，其中隔夜品种报 2.3770%，下跌 6.20 个基点；7 天品种报 2.6120%，下跌 0.30 个基点；1 个月品种报 2.6680%，下跌 1.40 个基点；3 个月品种报 2.8010%，上涨 0.10 个基点。今日资金面延续宽松态势，早盘大行减点融出隔夜资金，7 天及以上期限供大于求，午后隔夜加权融出，临近尾盘部分银行回补头寸，需求均可满足。

国债期货早盘小幅低开，随后震荡偏强，临近午盘小幅收涨，午后跳水翻绿，尾盘收跌。10 年期国债期货主力合约 T1812 收报 94.995，较上个交易日下跌 0.12%；5 年期国债期货主力合约 TF1812 收报 98.000，较上个交易日下跌 0.05%；2 年期国债期货主力合约 TS1812 收报 99.510，较上个交易日下跌 0.01%。今日银行间市场资金面维持宽松态势，现券收益率长端跟随国债期货走势，收益率小幅上行。截至目前，剩余期限 9.72 年的国开债活跃券 180210 收益率报 4.175%/4.17%，剩余期限 9.84 年的国债活跃券 180019 收益率报 3.595%/3.5825%。

周一人民币兑美元中间价报 6.9154，较上个交易日下调 34 点。在岸人民币兑美元早盘上行后维持震荡，午后一路下行，回吐全部涨幅，截至 16:30，在岸人民币兑美元收报 6.9270，较上一个交易日官方收盘价下跌 36 点；离岸人民币兑美元震荡走弱，午后跌幅明显扩大，现报 6.9293，较上个交易日下挫 81 点，两岸汇差目前维持在 20 点附近。美元指数早盘震荡，午后一路下行，现报 95.17，较上一个交易日下跌 0.09%。

上周五（10 月 12 日）CFETS 人民币汇率指数录得 92.38，按周上行 0.03；参考 BIS 货币篮子的人民币汇率指数录得 95.97，按周下行 0.04，参考 SDR 货币篮子的人民币汇率指数录得 91.80，按周下行 0.43。

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