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

【2018-11-05】

今日央行开展 MLF 操作 4035 亿元，MLF 到期 4035 亿元，资金零投放零回笼。Shibor 利率多数下跌，其中隔夜品种报 2.4345%，下跌 4.25 个基点；7 天品种报 2.6380%，下跌 1.10 个基点；1 个月品种报 2.6910%，下跌 0.30 个基点；3 个月品种报 2.9860%，上涨 0.50 个基点。今日资金面依旧宽松，早盘大行融出隔夜，需求较快满足，7 天、14 天期限融出较多、融入有限，更长期限需求寥寥，有少量非银融入长期限资金，午后资金面变化不大，隔夜价格下行。

今日发行的 3 年期、5 年期农发行固息增发债中标利率分别为 3.41%、3.7631%，全场倍数分别为 3.18 倍、3.47 倍，边际倍数分别为 2 倍、8 倍。国债期货早盘高开低走，随后逐渐走升，午后维持强势，全线上涨。10 年期国债期货主力合约 T1812 收报 95.575，较上个交易日上涨 0.08%； 5 年期国债期货主力合约 TF1812 收报 98.190，较上个交易日上涨 0.05%；2 年期国债期货主力合约 TS1812 收报 99.655，较上个交易日上涨 0.05%。今日市场继续股债跷跷板效应，现券收益率全天小幅下行。截至目前，剩余期限 9.67 年的国开债活跃券 180210 收益率报 4.10%/4.09%，剩余期限 9.78 年的国债活跃券 180019 收益率报 3.53%/3.515%。

周一人民币兑美元中间价报 6.8976，较上个交易日上调 395 点。在岸、离岸人民币兑美元全天一路下行，双双跌破 6.92 关口，截至 16:30，在岸人民币兑美元收报 6.9265，较上一个交易日官方收盘价大幅下挫 368 点；离岸人民币兑美元现报 6.9218，较上个交易日下跌 216 点；目前两岸汇差倒挂在 40 点附近。美元指数全天弱势震荡，午后小幅下探，随后反弹，现报 96.47，较上一个交易日微跌 0.04%。

上周五（11 月 2 日）CFETS 人民币汇率指数录得 92.31，按周下行 0.01；参考 BIS 货币篮子的人民币汇率指数录得 95.97，按周上行 0.04，参考 SDR 货币篮子的人民币汇率指数录得 92.13，按周下行 0.01。

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。