

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

【2020-10-15】

今日央行开展 5000 亿元中期借贷便利 (MLF) 操作和 500 亿元逆回购操作, 无逆回购到期, 全口径资金净投放 5500 亿元。Shibor 利率多数上涨, 其中隔夜品种报 2.0630%, 较上个交易日上涨 10.10 个基点; 7 天品种报 2.1910%, 较上个交易日上涨 5.50 个基点; 1 个月品种报 2.6330%, 较上个交易日下跌 0.40 个基点; 3 个月品种报 2.7740%, 较上个交易日上涨 1.70 个基点。今日资金面呈均衡宽松态势, 早盘国股大行少量融出, 午后资金面趋于宽松直至收盘。

今日国家统计局公布数据显示, 中国 9 月 CPI 同比涨 1.7%, 预期涨 1.8%, 前值涨 2.4%。中国 9 月 PPI 同比下降 2.1%, 预期降 1.7%, 前值降 2%。

今日早间发行的 3 年期、10 年期[160303Z26.IB]、10 年期[200310Z27.IB]进出口行固息增发债中标利率分别为 3.2953%、3.5705%、3.8446%, 全场倍数分别为 5.32 倍、3.87 倍、4.82 倍, 边际倍数分别为 1.85 倍、2.57 倍、3.03 倍, 午后发行的国开行 1 年期固息增发债、10 年期固息新发债中标利率分别为 2.7245%、3.7000%, 全场倍数分别为 4.24 倍、3.88 倍, 边际倍数分别为 3.83 倍、1.34 倍。国债期货早盘冲高回落, 午后持续低位震荡, 10 年期国债期货主力合约 T2012 收报 97.355, 较上个交易日下跌 0.08%; 5 年期国债期货主力合约 TF2012 收报 99.330, 较上个交易日下跌 0.11%; 2 年期国债期货主力合约 TS2012 收报 100.060, 较上个交易日下跌 0.05%。今日现券收益率小幅上行。截至目前, 剩余期限 9.67 年的国开债活跃券 200210 收益率报 3.7775%/3.775%, 剩余期限 9.60 年的国债活跃券 200006 收益率报 3.23%/3.225%。

周四人民币兑美元中间报价 6.7374, 较上个交易日上调 99 点。在岸、离岸人民币兑美元早盘冲高, 随后震荡下行, 截至 16:30, 在岸人民币兑美元收报 6.7300, 较上个交易日官方收盘价升值 70 点。离岸人民币兑美元现报 6.7258, 较上个交易日收盘价贬值 124 点, 目前两岸汇差倒挂在 42 点附近。美元指数震荡上行, 现报 93.53, 较上个交易日下跌 0.01%。

以上仅供参考, 谢谢!

文/Neal Tao

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