



【2019-10-28】

今日央行开展中央国库现金管理商业银行定期存款操作 600 亿元，逆回购到期 500 亿元，逆回购资金净回笼 500 亿。Shibor 利率涨跌互现，其中隔夜品种报 2.4780%，较上个交易日下跌 2.80 个基点；7 天品种报 2.6710%，较上个交易日上涨 0.20 个基点；1 个月品种报 2.7730%，较上个交易日下跌 0.10 个基点；3 个月品种报 2.8400%，较上个交易日上涨 0.90 个基点。今日隔夜资金全天表现均衡偏松，早盘银行押利率加权融出，下午有减点成交；7 天跨月期限需求较多；14 天至 21 天期限以融出为主。

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 3.0268%、3.5009%，全场倍数分别为 3.54 倍、2.09 倍，边际倍数分别为 1.39 倍、1.42 倍。国债期货早盘低开低走，午后小幅回升，尾盘下行。10 年期国债期货主力合约 T1912 收报 97.420，较上个交易日下跌 0.32%；5 年期国债期货主力合约 TF1912 收报 99.415，较上个交易日下跌 0.14%；2 年期国债期货主力合约 TS1912 收报 100.105，较上个交易日下跌 0.08%。受中美贸易谈判释放积极信号等因素影响，今日债市低开低走。截至目前，剩余期限 9.56 年的国开债活跃券 190210 收益率报 3.7475%/3.7450%，剩余期限 9.57 年的国债活跃券 190006 收益率报 3.2900%/3.2860%。

周一人民币兑美元中间报价 7.0762，较上个交易日下调 13 点。在岸、离岸人民币兑美元全天震荡走低，截至 16:30，在岸人民币兑美元收报 7.0615，较上个交易日官方收盘价上涨 101 点。离岸人民币兑美元现报 7.0594，较上个交易日收盘价下跌 83 点，目前两岸汇差倒挂在 21 点附近。美元指数早盘上行，随后全天震荡走低，现报 97.77，较上个交易日下跌 0.08%。

上周最后一个交易日（10 月 25 日）CFETS 人民币汇率指数录得 90.92，按周下降 0.14；参考 BIS 货币篮子的人民币汇率指数录得 94.47，按周下降 0.17；参考 SDR 货币篮子的人民币汇率指数录得 90.97，按周持平。

以上仅供参考，谢谢！

文/Dshlin Dong

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