

市场概述 每日市场动态

常规报告系列



【2023-09-18】

今日央行开展 1840 亿 7 天期、600 亿 14 天期逆回购操作，此外进行 500 亿国库现金定存操作，逆回购到期 2150 亿，全口径资金净投放 790 亿。Shibor 利率多数上行，其中隔夜品种报 1.9120%，上行 14.90 个基点；7 天品种报 1.8910%，下行 0.90 个基点；1 个月品种报 2.1100%，上行 2.70 个基点；3 个月品种报 2.1940%，上行 2.90 个基点。今日资金面早盘均衡，日内边际收敛，短期限资金价格有所上行。

上午发行的 3 年期、5 年期农发债中标收益率分别为 2.3876%、2.5684%，全场倍数分别为 3.99 倍、3.26 倍，边际倍数分别为 17.27 倍、3.33 倍。国债期货全天弱势震荡，主力合约全线收跌。30 年期国债期货主力合约 TL2312 收报 98.930，较上个交易日下跌 0.29%；10 年期国债期货主力合约 T2312 收报 101.710，较上个交易日下跌 0.12%；5 年期国债期货主力合约 TF2312 收报 101.805，较上个交易日下跌 0.13%；2 年期国债期货主力合约 TS2312 收报 101.135，较上个交易日下跌 0.05%。债券市场交投活跃，现券收益率早盘震荡走升，午后有所回落，短端上行幅度较大，截至目前，剩余期限 9.67 年的国开债活跃券 230210 收

益率报 2.7600%/2.7575%，剩余期限 9.68 年的国债活跃券 230012 收益率报 2.6740%/2.6710%。

周一美元兑人民币中间价报 7.1736，较上个交易日下调 50 点。今日美元兑在岸、离岸人民币早盘走升后横盘震荡，午后涨幅扩大，截至 16:30，美元兑在岸人民币收报 7.2920，较上一交易日上涨 229 个基点；美元兑离岸人民币现报 7.2957，较上一交易日上涨 150 个基点，目前两岸汇差在 40 个基点附近。美元指数维持弱势震荡，现报 105.29，较上一交易日下跌 0.04%。

外汇交易中心今早公布数据显示，9 月 15 日当周三人民币指数全线上行，CFETS 人民币汇率指数报 98.51，按周上涨 0.74；BIS 货币篮子人民币汇率指数报 103.00，按周上涨 0.83；SDR 货币篮子人民币汇率指数报 93.55，按周上涨 0.94。

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：SHOffice@cfets-nex.com.cn

扫描二维码 轻松查看更多资讯



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

禁止处理涉密信息和内部敏感信息