



【2020-10-12】

今日央行未开展逆回购操作，有 600 亿元逆回购到期，逆回购资金净回笼 600 亿元。Shibor 利率涨跌互现，其中隔夜品种报 1.5300%，较上个交易日下跌 9.80 个基点；7 天品种报 2.0730%，较上个交易日上涨 4.40 个基点；1 个月品种报 2.6350%，较上个交易日下跌 1.40 个基点；3 个月品种报 2.7220%，较上个交易日上涨 0.70 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隔夜期限资金，午后资金面趋于宽松直至收盘。

今日午后发行的 3 年期、5 年期[170412Z17.IB]、5 年期[200408Z2.IB] 农发行固息增发债中标利率分别为 3.2565%、3.0315%、3.5386%，全场倍数分别为 7.52 倍、5.01 倍、4.29 倍，边际倍数分别为 1.14 倍、1.84 倍、1.31 倍。今日国债期货早盘小幅低开，随后持续震荡上行，10 年期国债期货主力合约 T2012 收报 97.625，较上个交易日上涨 0.12%；5 年期国债期货主力合约 TF2012 收报 99.565，较上个交易日上涨 0.11%；2 年期国债期货主力合约 TS2012 收报 100.145，较上个交易日上涨 0.04%。今日现券收益率小幅下行。截至目前，剩余期限 9.68 年的国开债活跃券 200210 收益率报 3.745%/3.7425%，剩余期限 9.61 年的国债活跃券 200006 收益率报 3.182%/3.175%。

周一人民币兑美元中间报价 6.7126，较上个交易日上调 670 点。在岸、离岸人民币兑美元早盘双双大幅低开，随后持续回升，北京时间下午 4 时后直线走低，截至 16:30，在岸人民币兑美元收报 6.7358，较上个交易日官方收盘价贬值 223 点。离岸人民币兑美元现报 6.7327，较上个交易日收盘价贬值 426 点，目前两岸汇差倒挂在 31 点附近。美元指数早盘高开低走，午后有所回升，现报 93.12，较上个交易日上涨 0.12%。

上周最后一个交易日（10 月 9 日）CFETS 人民币汇率指数录得 94.26，按周下跌 0.14；参考 BIS 货币篮子的人民币汇率指数录得 98.01，按周下跌 0.15；参考 SDR 货币篮子的人民币汇率指数录得 92.70，按周上涨 0.25。

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