



【2019-11-01】

今日央行发公告称，目前银行体系流动性总量处于较高水平，可吸收央行逆回购到期等因素的影响，不开展逆回购操作，逆回购到期 300 亿元，资金净回笼 300 亿。Shibor 利率涨跌互现，其中隔夜品种报 2.3010%，较上个交易日下跌 28.90 个基点；7 天品种报 2.6160%，较上个交易日下跌 6.90 个基点；1 个月品种报 2.7750%，较上个交易日持平；3 个月品种报 2.8970%，较上个交易日上涨 1.00 个基点。今日月初隔夜资金全天宽松，各类型机构均有融出；7 天至 14 天期限需求较少；一个月以及更长期限成交较少。

今日发行的 91 天期贴现国债加权中标利率为 2.4685%，边际利率为 2.5418%，全场倍数为 2.41 倍，边际倍数为 1.23 倍。国债期货早盘高开探底回升，随后维持震荡。10 年期国债期货主力合约 T1912 收报 97.500，较上个交易日上涨 0.10%；5 年期国债期货主力合约 TF1912 收报 99.440，较上个交易日上涨 0.09%；2 年期国债期货主力合约 TS1912 收报 100.150，较上个交易日上涨 0.08%。今日现券收益率窄幅波动。截至目前，剩余期限 9.55 年的国开债活跃券 190210 收益率报 3.7700%/3.7675%，剩余期限 9.56 年的国债活跃券 190006 收益率报 3.2725%/3.2675%。

周五人民币兑美元中间报价 7.0437，较上个交易日上调 96 点。在岸人民币兑美元早盘低开震荡，午后冲高回落，尾盘再次上行，截至 16:30，在岸人民币兑美元收报 7.0376，较上个交易日官方收盘价下跌 26 点。离岸人民币兑美元全天震荡上行，现报 7.0405，较上个交易日收盘价上涨 61 点，目前两岸汇差在 29 点附近。美元指数全天维持震荡，现报 97.23，较上个交易日下跌 0.08%。

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