



【2019-10-14】

今日央行发公告称，目前银行体系流动性总量处于合理充裕水平，不开展逆回购操作，无逆回购到期，资金零投放零回笼。Shibor 利率多数上涨，其中隔夜品种报 2.5550%，较上个交易日上涨 34.00 个基点；7 天品种报 2.6510%，较上个交易日上涨 6.00 个基点；1 个月品种报 2.6990%，较上个交易日持平；3 个月品种报 2.7220%，较上个交易日上涨 0.30 个基点。今日资金面总体均衡，早盘大行股份制融出隔夜较少，下午隔夜呈现均衡偏紧态势；7 天至 14 天期限非银融出较多，全天宽松；21 天跨季需求明显增多。

今日海关总署发布数据显示，中国 9 月出口以人民币计同比降 0.7%，前值升 2.6%；进口以人民币计同比降 6.2%，前值降 2.6%；9 月进出口以人民币计同比降 3.3%，前值升 0.1%。中国 9 月出口以美元计同比降 3.2%，预期降 2.6%，前值降 1%；进口以美元计降 8.5%，预期降 4.7%，前值降 5.6%；贸易顺差 396.5 亿美元，前值 348.4 亿美元。1-9 月出口以美元计同比降 0.1%；进口降 5.0%；贸易顺差 2984.3 亿美元。

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 3.0018%、3.3962%，全场倍数分别为 3.43 倍、3.50 倍，边际倍数分别为 18.33 倍、3.24 倍。国债期货早盘低开，全天震荡走高。10 年期国债期货主力合约 T1912 收报 98.150，较上个交易日上涨 0.09%；5 年期国债期货主力合约 TF1912 收报 99.695，较上个交易日上涨 0.03%；2 年期国债期货主力合约 TS1912 收报 100.245，较上个交易日上涨 0.02%。今日现券收益率早盘走高，午后回落，收益率较上个交易日略有下行。截至目前，剩余期限 9.60 年的国开债活跃券 190210 收益率报 3.6475%/3.6400%，剩余期限 9.61 年的国债活跃券 190006 收益率报 3.1650%/3.1575%。

周一人民币兑美元中间报价 7.0725 较上个交易日上调 2 点。在岸、离岸人民币兑美元早盘双双走强，午后震荡走低，截至 16:30，在岸人民币兑美元收报 7.0669，较上个交易日官方收盘价上涨 331 点。离岸人民币兑美元现报 7.0696，较上个交易日收盘价上涨 186 点，目前两岸汇差在 27 点附近。美元指数早盘走低，午后震荡上行随后回落，现报 98.46，较上个交易日上涨 0.13%。

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