【2023-10-13】

今日央行开展 950 亿 7 天期逆回购操作，无逆回购到期，全口径资金净投放 950 亿。Shibor 利率涨跌互现，其中隔夜品种报 1.7410%，下行 6.90 个基点；7 天品种报 1.8930%，上行 0.40 个基点；1 个月品种报 2.2290%，下行 0.50 个基点；3 个月品种报 2.3080%，上行 0.30 个基点。今日资金面早盘均衡，日内边际趋松，短期限资金价格整体下行。

今日统计局公布 9 月通胀数据显示，9 月 CPI 同比 0%，前值 0.1%；PPI 同比 -2.5%，前值 -3%。海关公布 9 月进出口数据显示，按美元计，9 月出口同比-6.2%，前值 -8.8%；进口同比-6.2%，前值 -7.3%；贸易顺差 777.1 亿美元，前值 683.6 亿美元。下午央行公布 9 月金融数据显示，9 月社会融资规模增量 41200 亿人民币，前值 31200 亿人民币；新增人民币贷款 23100 亿人民币，前值 13600 亿人民币；M2 货币供应同比 10.3%，前值 10.6%。

上午发行的 1 年期、10 年期进出口行债中标收益率分别为 2.1088 %、2.8391 %，全场倍数分别为 4.57 倍、6.17 倍，边际倍数分别为 1.46 倍、3.04 倍；下午发行的 91 天期、5 年

期、30 年期附息国债中标收益率分别为 1.9244 %、2.5500 %、3.0000 %，其中，91 天期、5 年期边际利率分别为 2.1510 %、2.5700%，全场倍数分别为 1.56 倍、3.19 倍、3.78 倍，边际倍数分别为 3.40 倍、6.41 倍、2.97 倍。国债期货高开震荡，午后走高，主力合约全线收涨。30 年期国债期货主力合约 TL2312 收报 98.710，较上个交易日上涨 0.19%；10 年期国债期货主力合约 T2312 收报 101.660，较上个交易日上涨 0.09%；5 年期国债期货主力合约 TF2312 收报 101.770，较上个交易日上涨 0.09%；2 年期国债期货主力合约 TS2312 收报 101.105，较上个交易日上涨 0.03%。债券市场交投活跃，现券收益率早盘下行后维持震荡，午后走高，金融数据公布后回落，截至目前，剩余期限 9.61 年的国开债活跃券 230210 收益率报 2.7650%/2.7625%，剩余期限 9.87 年的国债活跃券 230018 收益率报 2.6725%/2.6675%。

周五美元兑人民币中间价报 7.1775，较上个交易日下调 1 点。今日美元兑在岸、离岸人民币日内维持震荡，截至 16:30，美元兑在岸人民币收报 7.3040，较上一交易日下跌 99 个基点；美元兑离岸人民币现报 7.3083，较上一交易日下跌 15 个基点，目前两岸汇差倒挂 36 个基点附近。美元指数震荡走低，现报 106.34，较上一交易日下跌 0.23%。

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
禁止处理涉密信息和内部敏感信息
禁止处理涉密信息和内部敏感信息