



【2020-10-16】

今日央行开展了 500 亿元逆回购操作，无逆回购到期，此外有 2000 亿元中期借贷便利（MLF）到期，全口径资金净回笼 1500 亿元。Shibor 利率多数上涨，其中隔夜品种报 2.0170%，较上个交易日下跌 4.60 个基点；7 天品种报 2.1990%，较上个交易日上涨 0.80 个基点；1 个月品种报 2.6320%，较上个交易日下跌 0.10 个基点；3 个月品种报 2.7860%，较上个交易日上涨 1.20 个基点。今日资金面呈均衡宽松态势，早盘隔夜期限供给充足，午后资金面持续宽松直至收盘。

今日早间发行的 3 个月期贴现国债加权中标利率 2.5746%，边际利率 2.6730%，全场倍数 2.36 倍，边际倍数 2.57 倍，同时发行的 1 年期、3 年期进出口行固息增发债中标利率分别为 2.7372%、3.1360%，全场倍数分别为 2.69 倍、4.92 倍，边际倍数分别为 1.15 倍、1.25 倍。国债期货早盘小幅走低，随后震荡上涨，10 年期国债期货主力合约 T2012 收报 97.495，较上个交易日上涨 0.12%；5 年期国债期货主力合约 TF2012 收报 99.430，较上个交易日上涨 0.10%；2 年期国债期货主力合约 TS2012 收报 100.125，较上个交易日上涨 0.05%。今日现券收益率小幅下行。截至目前，剩余期限 9.67 年的国开债活跃券 200210 收益率报 3.765%/3.7625%，剩余期限 9.59 年的国债活跃券 200006 收益率报 3.215%/3.2125%。

周五人民币兑美元中间报价 6.7332，较上个交易日上调 42 点。在岸、离岸人民币兑美元早盘持续震荡，北京时间下午三点左右大幅拉升，截至 16:30，在岸人民币兑美元收报 6.6982，较上个交易日官方收盘价升值 318 点。离岸人民币兑美元现报 6.6914，较上个交易日收盘价升值 213 点，目前两岸汇差倒挂在 68 点附近。美元指数持续震荡，现报 93.71，较上个交易日下跌 0.09%。

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