



【2020-09-25】

今日央行开展了 1200 亿元 14 天期逆回购操作，今日有 1100 亿元逆回购到期，逆回购资金净投放 100 亿元。Shibor 利率涨跌互现，其中隔夜品种报 1.4240%，较上个交易日下跌 46.00 个基点；7 天品种报 2.1480%，较上个交易日下跌 0.10 个基点；1 个月品种报 2.6420%，较上个交易日上涨 1.50 个基点；3 个月品种报 2.6680%，较上个交易日下跌 0.20 个基点。今日资金面呈均衡宽松态势，早盘隔夜期限资金供给充足，国股大行大量融出，午后资金面持续宽松至收盘。

今日早间发行的 3 个月期贴现进出口行新发债、3 年期、5 年期、10 年期进出口行固息增发债中标利率分别为 2.0966%、3.2493%、3.4589%、3.7751%，全场倍数分别为 3.81 倍、3.69 倍、4.50 倍、5.31 倍，边际倍数分别为 1.09 倍、1.03 倍、1.24 倍、5.26 倍，午后发行的 1 年期、10 年期国开行固息增发债中标利率分别为 2.7034%、3.6421%，全场倍数分别为 3.21 倍、3.49 倍，边际倍数分别为 1.02 倍、1.11 倍，国债期货早盘高位震荡，午盘前快速走低，午后持续窄幅震荡，10 年期国债期货主力合约 T2012 收报 98.345，较上个交易日下跌 0.03%；5 年期国债期货主力合约 TF2012 收报 100.110，较上个交易日下跌 0.12%；2 年期国债期货主力合约 TS2012 收报 100.375，较上个交易日下跌 0.08%。今日现券收益率全天窄幅波动。截至目前，剩余期限 9.73 年的国开债活跃券 200210 收益率报 3.6825%/3.6825%，剩余期限 9.65 年的国债活跃券 200006 收益率报 3.0825%/3.08%。

周四人民币兑美元中间报价 6.8028，较上个交易日下调 42 点。在岸、离岸人民币兑美元双双震荡下行，截至 16:30，在岸人民币兑美元收报 6.8240，较上个交易日官方收盘价贬值 320 点。离岸人民币兑美元现报 6.8327，较上个交易日收盘价贬值 69 点，目前两岸汇差在 87 点附近。美元指数全天震荡，现报 94.40，较上个交易日上涨 0.04%。

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