



【2020-10-13】

今日央行未开展逆回购操作，有 1000 亿元逆回购到期，逆回购资金净回笼 1000 亿元。Shibor 利率全数上涨，其中隔夜品种报 1.7000%，较上个交易日上涨 17.00 个基点；7 天品种报 2.0920%，较上个交易日上涨 1.90 个基点；1 个月品种报 2.6360%，较上个交易日上涨 0.10 个基点；3 个月品种报 2.7340%，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，早盘隔夜期限资金供给少量，午后资金面趋于宽松直至收盘。

海关总署今日公布数据显示，第三季度我国进出口 8.88 万亿元，同比增长 7.5%。其中，出口 5 万亿元，增长 10.2%；进口 3.88 万亿元，增长 4.3%，三项数据均创下季度历史新高。我国 9 月出口同比(按人民币计) 8.7%，前值 11.6%，进口同比(按人民币计) 11.6%，前值 -0.5%，贸易顺差(按人民币计) 2576.8 亿人民币，前值 4165.9 亿人民币。9 月出口同比(按美元计) 9.9%，前值 9.5%，进口同比(按美元计) 13.2%，前值 -2.1%，贸易顺差(按美元计) 370 亿美元，前值 589.3 亿美元。

今日早间发行的 3 年期国开行固息增发债中标利率为 3.2375%，全场倍数为 4.38 倍；5 年期、7 年期、20 年期国开行固息增发债中标利率分别为 3.4629%、3.6450%、3.9783%，全场倍数分别为 3.94 倍、5.47 倍、7.77 倍，边际倍数分别为 2.58 倍、1.35 倍、2.92 倍，午后发行的 2 年期、7 年期农发行上清所托管固息增发债中标利率分别为 3.1551%、3.6910%，全场倍数分别为 6.34 倍、4.65 倍，边际倍数分别为 2.43 倍、1.20 倍。今日国债期货早盘窄幅波动，午后震荡下行，10 年期国债期货主力合约 T2012 收报 97.535，较上个交易日下跌 0.09%；5 年期国债期货主力合约 TF2012 收报 99.570，较上个交易日下跌 0.01%；2 年期国债期货主力合约 TS2012 收报 100.165，较上个交易日上涨 0.01%。今日现券收益率小幅上行。截至目前，剩余期限 9.68 年的国开债活跃券 200210 收益率报 3.74%/3.74%，剩余期限 9.60 年的国债活跃券 200006 收益率报 3.19%/3.1875%。

周二人民币兑美元中间报价 6.7296,较上个交易日下调 170 点。在岸、离岸人民币兑美元早盘大幅走低,随后持续回升,截至 16:30,在岸人民币兑美元收报 6.7385,较上个交易日官方收盘价贬值 27 点。离岸人民币兑美元现报 6.7349,较上个交易日收盘价升值 82 点,目前两岸汇差倒挂在 36 点附近。美元指数震荡上行,现报 93.17,较上个交易日上涨 0.14%。

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