



【2019-09-17】

今日央行开展 MLF 操作 2000 亿元，逆回购到期 800 亿，MLF 到期 2650 亿，全口径资金净回笼 1450 亿。Shibor 利率涨跌互现，其中隔夜品种报 2.5650%，较上个交易日上涨 22.90 个基点；7 天品种报 2.6380%，较上个交易日下跌 0.40 个基点；1 个月品种报 2.6850%，较上个交易日上涨 0.30 个基点；3 个月品种报 2.7080%，较上个交易日下跌 0.20 个基点。今天早盘隔夜表现均衡，临近午盘逐渐转为均衡偏紧，午后隔夜需求旺盛但融出较少；7 天期限全天宽松，各类型机构均有融出；跨月期限表现紧张，价格以及成交量均较上个交易日上行；1 个月需求略有增多。

今日发行的 1 年期、5 年期、10 年期国开行固息增发债中标利率分别为 2.4278%、3.2045%、3.4500%，全场倍数分别为 3.59 倍、3.05 倍、3.50 倍，边际倍数分别为 18.14 倍、1.07 倍、48.72 倍。下午农发行在上交所发行的 2 年期固息增发债，中标利率为 2.8009%，全场倍数为 4.22 倍，边际倍数为 1.58 倍。国债期货早盘高开低走，随后维持震荡，午后再次下行，尾盘收跌。10 年期国债期货主力合约 T1912 收报 98.420，较上个交易日下跌 0.15%；5 年期国债期货主力合约 TF1912 收报 99.820，较上个交易日下跌 0.08%；2 年期国债期货主力合约 TS1912 收报 100.255，较上个交易日下跌 0.03%。今日现券收益率早盘小幅下行，受央行 MLF 未超额续作以及无逆回购操作影响，收益率开始上行，截至目前，剩余期限 9.67 年的国开债活跃券 190210 收益率报 3.5700%/3.5675%，剩余期限 9.68 年的国债活跃券 190006 收益率报 3.1100%/3.0900%。

周二人民币兑美元中间报价 7.0730，较上个交易日下调 73 点。在岸人民币兑美元早盘高开迅速走弱，午盘震荡，午后小幅走低，截至 16:30，在岸人民币兑美元收报 7.0929，较上个交易日官方收盘价下跌 289 点。离岸人民币兑美元全天震荡走弱，现报 7.0893，较上个交易日收盘价下跌 271 点，目前两岸汇差倒挂在 36 点附近。美元指数早盘震荡，午后冲高回落，现报 98.58，较上个交易日下跌 0.08%。

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