



【2020-09-18】

今日央行开展了 1100 亿元 7 天期和 600 亿元 14 天期逆回购操作，有 900 亿元逆回购和 500 亿元国库现金定存到期，全口径资金净投放 300 亿元。Shibor 利率短端上涨，长端下跌，其中隔夜品种报 2.1010%，较上个交易日上涨 33.20 个基点；7 天品种报 2.2330%，较上个交易日上涨 3.40 个基点；1 个月品种报 2.6090%，较上个交易日上涨 0.60 个基点；3 个月品种报 2.6790%，较上个交易日下跌 0.70 个基点。今日资金面早盘延续昨日紧张态势，隔夜期限仅少量融出，午后资金面持续紧张，尾盘稍有缓解。

今日早间发行的 3 年期国开行固息新发债、3 年期、10 年期国开行固息增发债中标利率分别为 2.8900%、2.7905%、3.1330%，全场倍数分别为 5.40 倍、6.91 倍、6.42 倍，边际倍数分别为 1.00 倍、7.00 倍、1.50 倍，同时发行的 1 年期、2 年期、10 年期进出口行固息增发债中标利率分别为 2.7178%、3.1190%、3.4665%，全场倍数分别为 4.25 倍、5.63 倍、5.50 倍，边际倍数分别为 1.22 倍、1.51 倍、7.17 倍，同时发行的 3 个月期、50 年期国债加权中标利率分别为 2.2775%、3.9998%，其中 3 个月期贴现国债边际利率为 2.3318%，全场倍数分别为 2.95 倍、2.04 倍，边际倍数分别为 2.51 倍、2.23 倍。国债期货早盘震荡走高，午后持续下跌，10 年期国债期货主力合约 T2012 收报 97.865，较上个交易日下跌 0.02%；5 年期国债期货主力合约 TF2012 收报 99.950，较上个交易日上涨 0.07%；2 年期国债期货主力合约 TS2012 收报 100.385，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 9.75 年的国开债活跃券 200210 收益率报 3.6775%/3.675%，剩余期限 9.67 年的国债活跃券 200006 收益率报 3.12%/3.115%。

周五人民币兑美元中间报价 6.7591，较上个交易日上调 84 点。在岸人民币兑美元震荡走低，截至 16:30，在岸人民币兑美元收报 6.7588，较上个交易日官方收盘价上涨 71 点。离岸人民币兑美元全天震荡，现报 6.7570，较上个交易日收盘价下跌 30 点，目前两岸汇差倒挂在 18 点附近。美元指数窄幅波动，现报 92.84，较上个交易日下跌 0.07%。

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