

1、公开市场操作

10月10日，央行公开市场到期及操作情况详见下表。10月11日无逆回购到期。

名称	发行/到期	日期	发行量/亿
逆回购	到期	指标名称	0
逆回购7D	发行	指标名称	0
逆回购14D	发行	指标名称	0
逆回购28D	发行	指标名称	0
逆回购63D	发行	指标名称	0
本日净冲销			0

2、资金面

资金面继续维持宽松态势，早盘多数机构减点融出大量隔夜资金，加权利率降至2.42，需求很快得到满足。7d、14d资金多在2.6及以上融出，午后资金面继续宽松，宽松态势直至尾盘。

品种	银行间回购		交易所回购		同业存款	
	收益率	日变化	收益率	日变化	收益率	日变化
O/N	2.41	(10.90)	2.32	(49.00)	-	-
7D	2.66	(1.06)	2.56	(29.50)	2.45	15.00
14D	2.80	7.46	2.63	(18.00)	2.58	28.00
21D	3.48	65.01	-	-	-	-
1M/28D	2.93	(8.49)	2.75	(10.00)	2.70	0.00
3M	3.06	(7.41)	3.01	1.00	2.80	0.00
6M	-	-	2.90	13.00	3.25	(5.00)

3、一级存单

	1M	3M	6M	9M	1Y
AAA（股份行）/%	2.55	2.69	3.22(-6)	3.49	3.56(2)
AAA（非股份行）/%	2.63 (3)	3.01(23)	3.34	3.56(1)	3.64(4)
公告量/亿	129.4	69.9	100.9	127.5	235.4
AA+/%	2.65	3(1)	3.43(-16)	3.6	3.77(-8)
公告量/亿	31.3	11.7	26.6	7	55.4
AA/%	2.7 (-2)	3.13(2)	3.54(-17)		3.95 (-4)
公告量/亿	7	16.5	28.2		7.7
总公告886.1亿	174.3	110.9	159.7	134.5	306.7
前一日875.1亿	169.5	130.9	145.2	157	272.5

4、银行间债券

短融市场成交相对活跃，年内到期成交增多，1-2M在2.75-3.0之间为主，城投类在3.2-3.3，半年左右的成交在3.3-3.6之间，9M以上仍是优质AAA，电网成交突出，大量成交在3.58，整体估值小幅减点成交。参与机构来看，买盘主要为基金、保险、银行，卖盘主要为基金、银行。

中票市场交投非常活跃，3Y内及5Y期大量成交，1Y期AAA在3.8左右，2Y期AAA在4.05左右，同期限过剩及地产类上浮30-40bp不等，近3Y期好资质AAA在4.1-4.2之间，4Y及以上AAA在4.4-4.55之间为主，整体估值小幅减点成交。参与机构方面，银行和保险的买盘参与力度增强，卖盘主要是基金和券商。

企业债交投较为活跃，AAA至AA均有成交，久期偏好仍然在短端，3年内个券占绝大多数，收益率整体下行。1-3年高评级个券成交减点5-10bp左右。买盘以基金和券商为主，卖盘主要是资管和基金。

5、国内外其他重要数据

品种	数值	日变化	大宗商品	涨跌幅
上证综指	2725.84	0.18%	SHFE黄金	0.02%
深证成指	8010.69	-0.44%	DCE铁矿石	1.58%
			DCE焦煤	2.10%