

1、公开市场操作

10月11日，央行公开市场到期及操作情况详见下表。10月12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

资金面维持宽松，各期限资金价格维持低位，加权价格变化不大，早盘各机构积极融出资金，非银隔夜加权+5-+10bp、7d 2.6-2.7,14d 2.8,1M 2.9，成交集中在隔夜、7天，14d以上需求较少;宽松持续至尾盘。整体资金面与昨日变化不大。

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	2.38	(3.54)	2.37	5.50	-	-
7D	2.63	(2.53)	2.51	(5.00)	2.45	0.00
14D	2.81	0.96	2.59	(4.00)	2.58	0.00
21D	3.22	(25.80)	-	-	-	-
1M/28D	2.89	(3.79)	2.73	(2.00)	2.65	(5.00)
3M	3.11	5.50	2.89	(12.00)	2.80	0.00
6M	-	-	2.62	(28.00)	3.25	0.00

3、一级存单

	1M	3M	6M	9M	1Y
AAA (股份行) /%	2.55	2.8 (11)	3.27 (5)	3.5 (2)	3.55 (-1)
AAA (非股份行) /%	2.6 (-3)	3.03 (2)	3.37 (3)	3.56	3.64 (-1)
公告量/亿	244.6	199.3	104.6	396	227.5
AA+ /%	2.64 (-1)	3.11 (10)	3.64 (21)	3.6	3.75 (-2)
公告量/亿	47	11.3	31	6	41.2
AA /%	2.69 (-1)	3.14 (1)	3.56 (2)		3.85 (-10)
公告量/亿	12	29.5	16.7		10
总公告1401.7亿	303.6	252.6	154.3	405	286.2
前一日886.1亿	174.3	110.9	159.7	134.5	306.7

4、银行间债券

短融市场交投活跃，以AAA为主，多在9M以内，不跨年1-2M在2.7-2.75成交，资质稍弱的在3.；3-6M成交在3.5附近，半年期到9M成交在3.4-3.6之间整体估值减点为主。

中票市场交投依旧非常活跃，仍以3Y内AAA为主，5Y也有一定成交;1Y期AAA在3.7-3.9之间估值附近成交，1.5-2Y期成交在4.0-4.1，2Y+优质AAA在4.05-4.08之间，4Y+长期限优质者成交在4.3-4.45之间，较昨日下行约10bp，整体看估值减点5-10bp成交居多。参与机构方面，买盘各类机构均有参与，卖盘主要是基金。

企业债交投活跃，收益率大幅下行，高评级收益率整体下行10bp左右，3Y左右个券下行较为明显。参与机构方面，买盘以基金和券商为主，卖盘主要是基金。

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	2583.46	-1.31%	SHFE黄金	1.73%
深证成指	7524.09	-6.07%	DCE铁矿石	0.39%
			DCE焦煤	0.22%