



弘业期货股份有限公司
HOLLY FUTURES CO., LTD.



金融研究院

金融期货日报

2018 年 9 月 21 日星期五

弘业期货 金融期货研究所

国债期货日报..... 2

史珂 国债期货分析师

Tel: 025-52278713

Email:

shike@ftol.com.cn

从业资格号: F3007722

请务必阅读正文最后免责声明部分

www.baogaoba.xyz 獨家收集 百萬報告 实时更新 日更千篇

国债期货日报

史珂 国债期货分析师

Tel: 025-52278713

Email:

shike@ftol.com.cn

从业资格号: F3007722

一、行情回顾

今日5年期国债期货主力合约TF1812报收于97.410,涨幅0.13%,最高97.425,最低97.180,成交量5687手,持仓量19392手,日减仓336手;10年期国债期货主力合约T1812报收于94.185,涨幅0.2%,最高94.200,最低93.875,成交量3.12万手,持仓量56207手,日减仓1686手;2年期国债期货主力合约TS1812报收于99.320,涨幅0.04%,最高99.320,最低99.270,成交量140手,持仓量3038手,日减仓63手。

尽管央行今日暂停逆回购操作,但是资金面仍然维持平衡宽松,银存间质押式回购利率涨跌不一,跨月价格上涨,shibor多数上行,短期品种走低。下周(9月22日-9月30日)央行公开市场将有2900亿元逆回购到期。国债期货结束三日连跌,低开高走收涨。今日期债小幅回暖,但是短期下行压力仍存。

二、重要经济资讯

1. 央行公告称,考虑到月末财政支出、中央国库现金管理操作可对冲政府债券发行缴款、央行逆回购到期等因素的影响,为维护银行体系流动性合理充裕,9月21日不开展逆回购操作。今日有1100亿元逆回购到期,净回笼1100亿元,连续2日净回笼。本周公开市场全口径净投放3250亿元。
2. 9月21日,Shibor多数上涨。隔夜Shibor跌0.5bp报2.5140%,7天Shibor跌0.5bp报2.6540%,14天Shibor涨1.3bp报2.7460%,1个月Shibor涨0.1bp报2.7540%。

请务必阅读正文最后免责声明部分

www.baogaoba.xyz 獨家收集 百萬報告 实时更新 日更千篇

分析师声明

作者具有中国期货业协会授予的期货投资咨询执业资格或相当的专业胜任能力，保证报告所采用的数据均来自合规渠道，分析逻辑基于作者的职业理解，本报告清晰准确地反映了作者的研究观点，力求独立、客观和公正，结论不受任何第三方的授意或影响，特此声明。

免责声明

本报告中的信息均来源于公开资料，我公司对这些信息的准确性和完整性不作任何保证，也不保证所包含的信息和建议不会发生变更。

我们已力求报告内容的客观和公正，但文中的观点和建议仅供参考，客户应审慎考量本身需求。我公司及其雇员对使用本报告及其内容所引发的任何直接或间接损失概不负责。

本报告版权归弘业期货所有，未经书面许可，任何机构和个人不得翻版、复制和发布；如引用、刊发需注明出处为弘业期货，且不得对本报告进行有悖原意的引用、删节和修改。

联系方法

南京总部

地址：南京市中华路 50 号弘业大厦

网址：www.ftol.com.cn

全国统一客服热线：400-828-1288

金融研究院：025-52278932

苏州营业部 0512-68070198

苏州市高新区狮山路 35 号金河国际大厦 37 层

常州营业部 0519-88161261

常州市关河东路 66 号九州环宇国际商务广场 a 座 1610、1611 室

扬州营业部 0514-87314255

扬州市扬子江北路 368 号格兰云天酒店旁三层小商业

无锡营业部 0510-82701302

无锡市中山路 531 号红豆国际广场 1706、1707、1708、1709 室

北京营业部 010-68014881

北京市西城区月坛南街甲 12 号万丰怡和商务会馆 3 楼

上海营业部 021- 58308099

上海市浦东新区世纪大道 1589 号长泰国际金融大厦 609、1210-1211 室

南通营业部 0513-85113309

南通市姚港路 6 号方天大厦 703 室

青岛营业部 0532-85039479

青岛市香港中路 10 号颐和国际 A 座 2301、2303 室

合肥营业部 0551-2671810

合肥市蜀山区长江西路 200 号置地投资广场 1306、1307 室

徐州营业部 0516-85695258

徐州市中山南路 16 号成功大厦 22 楼 FGH 座

杭州营业部 0571-87185615

杭州市西湖大道 18 号新东方大厦 B 座 1401 室

郑州营业部 0371-65615320

郑州市未来大道 69 号未来大厦 1605 室

泰州营业部 0523-86211667

泰州市海陵区迎春西路 21 号 108-109 206-210 室

南宁营业部 0771-5760761

南宁市金州路 25 号太平洋世纪广场 A 座 21 层 2103-2104 室

镇江营业部 0511-85088168

镇江市京口区中山东路 18 号京凌大厦 901 室

福州营业部 0591-38118108

福州市鼓楼区东街 33 号武夷中心大厦 15 层 C 单元

大连营业部 0411-39799891

大连市沙区会展路 129 号期货交易大厦 A 座 2301、2302 室

请务必阅读正文最后免责声明部分

www.baogaoba.xyz 獨家收集 百萬報告 实时更新 日更千篇

长沙营业部 0731-84426856
长沙市芙蓉区韶山北路 139 号文化大厦 1701 室

西安营业部 029-87208280
西安市北大街 55 号新时代广场 12 楼 c 座

盐城营业部 0515—88889288
盐城市华邦东厦 2 幢 1906、1907、1908 室

济南营业部 0531-55592288
济南市市中区经七路 88 号房地产大厦 14 楼

天津营业部 022-58780777
天津市河西区围堤道 53 号丽晶大厦 2203 室

南昌营业部 0791-6653600
南昌市桃苑大厦 B2 座 3 楼

海口营业部 0898-66509189
海口市大同路 38 号财富中心 16 楼 1606 室

宿迁营业部 0527-84331588
宿迁市宿城区青海湖路 80 号中信·君临国际广场写字楼（南楼）12 层 A 座

沈阳营业部 024-31286433
沈阳市沈河区北站路 57 号财富中心 D 座 21 楼 3 号、4 号

武汉营业部 027-82797898
武汉市汉阳区中山大道 818 号平安大厦 2208、2209 室

广州营业部 020-22836333
广州市天河区体育东路 136-138 号金利来大厦 909-911 室

宁波营业部 0574-87869517
宁波市江东区惊驾路 555 号泰富广场 A 座 1903 室

连云港营业部 0518-85321108
连云港市新浦区苍梧路 6 号龙河大厦 A 座 1101-1108 室

重庆营业部 023-88367700
重庆市渝中区新华路 388 号首座大厦 615-617 室

太原营业部 0351-3377899
太原市杏花岭区府西街 9 号王府商务大厦 A 座 5 层 A 户

淮安营业部 0517-83900209
淮安市清河区淮海第一城办公楼 801-802（淮安市淮海东路曙光国家大厦 801-802）

芜湖营业部 0553-3917022
芜湖市镜湖区融汇中江广场西区 H#楼 1511、1512、1513、1514 室

成都营业部 028-84471800
成都市锦江区东大街芷泉段 68 号天府时代广场 A1 区 9 楼 03、04 号

深圳营业部 0755-22663166
深圳市福田区中心四路 1-1 号嘉里建设广场第三座第 5 层 03 室

请务必阅读正文最后免责声明部分

www.baogaoba.xyz 獨家收集 百萬報告 实时更新 日更千篇