

# 市场概述 每日市场动态

常规报告系列



**NEX** 上海国际货币经纪  
Shanghai CFETS-NEX International Money Broking

**【2018-06-07】**

今日央行公告称，考虑到银行体系流动性总量较高，加上地方国库现金管理操作等因素可一定程度吸收央行逆回购到期的影响，为维护银行体系流动性合理稳定，开展 400 亿元逆回购操作。今日逆回购到期 1100 亿元，资金净回笼 700 亿元。Shibor 利率涨跌互现，其中隔夜品种报 2.5550%，下跌 0.70 个基点；7 天品种报 2.7830%，下跌 0.90 个基点；1 个月品种报 4.0500%，上涨 0.80 个基点；3 个月品种报 4.3500%，下跌 0.40 个基点。今日资金面均衡偏松，月内资金依旧充裕，机构需求基本得以满足，7 天资金价格较昨日下降，跨月资金融出增多，但价格不低，更长期限资金成交寥寥。

今日发行的 91 天期、5 年期进出口行固息增发债中标利率分别为 2.7605%、4.3961%，全场倍数分别为 4.23 倍、3.83 倍，边际倍数分别为 1.67 倍、3.5 倍。下午发行的 7 年期、10 年期国开行固息增发债中标利率分别为 4.4887%、4.4255%，全场倍数分别为 3.64 倍、2.59 倍，边际倍数分别为 14 倍、4.21 倍。

国债期货早盘低开低走，午后小幅上涨，尾盘收跌。国债期货 10 年期国债期货主力合约 T1809 收报 94.460，较上个交易日下跌 0.05%；5 年期国债期货主力合约 TF1809 收报 97.415，较上个交易日下跌 0.05%。受海外债市走跌以及今日央行公开市场净回笼等因素影响，国内债市情绪低迷，现券收益率高开，随后窄幅震荡，截至目前，剩余期限 9.68 年的国开债活跃券 180205 收益率报 4.47%/4.47%；剩余期限 9.66 年的国债活跃券 180004 收益率报 3.69%/--%。

周四人民币兑美元中间价报 6.3919，较上个交易日上调 121 点，创逾三周最大升幅。在岸人民币兑美元早盘高开低走，午后振幅扩大，尾盘跌幅扩大，截至 16:30，在岸人民币兑美元收报 6.3933，较上一个交易日上涨 23 点；离岸人民币兑美元全天震荡下行，现报 6.3858，较上一个交易日下跌 85 点，两岸汇差倒挂在 75 点。受欧央行可能在 6 月 14 日讨论退出 QE 的冲击，美元指数全天下跌，午后跌幅扩大，现报 93.31，下跌 0.34%。

以上仅供参考，谢谢！

文/Vivian Shen

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**