



【2018-07-17】

今日央行发公告称，为对冲税期高峰等因素的影响，维护银行体系流动性合理充裕，以利率招标方式进行 700 亿元 7 天期、300 亿 14 天期逆回购操作。今日有 100 亿元逆回购到期，资金净投放 900 亿元。此外，财政部 3 个月国库现金定存中标利率 3.7%，中标利率较上期大幅下行。Shibor 利率涨跌互现，其中隔夜品种报 2.5910%，上涨 3.40 个基点；7 天品种报 2.7030%，上涨 0.40 个基点；1 个月品种报 3.2151%，上涨 0.51 个基点；3 个月品种报 3.6010%，下跌 0.70 个基点。今日资金面总体均衡，较昨日略微收紧，早盘隔夜资金融出较少，7 天期限偏均衡，14 天期限银行加权成交，21 天及以上期限成交较少；午后隔夜宽松，偶有减点成交，其他期限均成交较少。

今日发行的 1 年期、3 年期、10 年期国开行固息增发债中标利率分别为 3.2015%、3.7656%、4.0476%，全场倍数分别为 3.73 倍、3.47 倍、2.14 倍，边际倍数分别为 1.43 倍、1.04 倍、1.29 倍。国债期货全天窄幅震荡，小幅收涨。10 年期国债期货主力合约 T1809 收报 96.075，较上个交易日上涨 0.02%；5 年期国债期货主力合约 TF1809 收报 98.495，较上个交易日上涨 0.03%。本周以来，资金面维持小幅收敛态势，随着数据发布密集期的结束，消息面趋于冷清，债券市场窄幅震荡。截至目前，剩余期限 9.57 年的国开债活跃券 180205 收益率报 4.185%/4.18%，剩余期限 9.84 年的国债活跃券 180011 收益率报--%/3.47%。

周二人民币兑美元中间价报 6.6821，较上个交易日下调 63 点。在岸人民币兑美元早盘冲高回落，午后继续震荡走强，截至 16:30，在岸人民币兑美元收报 6.6790，较上个交易日上涨 48 点；离岸人民币兑美元午前震荡走高，午后回吐部分涨幅，现报 6.6950，较上个交易日上涨 77 点，目前两岸汇差在 170 点附近。美元指数震荡走低，维持弱势，现报 94.33，较上个交易日下跌 0.19%。

以上仅供参考，谢谢！

文/Ryan Rui

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