



【2018-05-18】

今日央行发布公告称，考虑到税期因素消退，银行体系流动性总量处于较高水平，不开展公开市场操作，今日无逆回购到期，资金零投放零回笼。Shibor 利率短端下跌、长端上涨，其中隔夜品种报 2.5630%，下跌 3.40 个基点；7 天品种报 2.7680%，下跌 3.50 个基点；1 个月品种报 3.8330%，上涨 0.20 个基点；3 个月品种报 4.1470%，上涨 4.60 个基点。今日早盘政策性银行融出隔夜至 2 个月期限资金，股份制、非银等融出隔夜至 7 天期限资金，临近午盘市场需求基本得到满足；午后股份制融出减点隔夜资金，市场延续宽松态势。

今日发行的 91 天期贴现国债加权中标利率为 2.7441%，边际中标利率为 2.8275%，全场倍数为 2.1 倍，边际倍数为 5 倍。发行的 50 年期附息国债中标利率为 4.13%，全场倍数为 2.24 倍，边际倍数为 1.42 倍。

国债期货早盘低开，随后冲高回落，临近午盘大幅拉升，午后延续涨势，收盘涨跌不一。国债期货 10 年期国债期货主力合约 T1809 收报 94.070，较上个交易日上涨 0.11%；5 年期国债期货主力合约 TF1809 收报 97.350，较上个交易日下跌 0.11%。随着税期影响减弱，今日资金面继续宽松，10 年期国债期货走势偏强，债市情绪总体平稳，现券收益率小幅下行，截至目前，剩余期限 9.74 年的国开债活跃券 180205 收益率报 4.5425%/4.5375%；剩余期限 9.72 年的国债活跃券 180004 收益率报 3.71%/3.70%。

周五人民币兑美元中间价报 6.3763，较上个交易日下调 84 点。在岸人民币兑美元早盘急跌，随后震荡回升，午后再度下行，截至 16:30，在岸人民币兑美元收报 6.3760，较上一个交易日下跌 89 点；离岸人民币兑美元早盘先降后升，午后小幅回落，现报 6.3598，较上一交易日下跌 22 点，两岸汇差目前倒挂 140 点左右。美元指数全天震荡下行，现报 93.42，下跌 0.06%。

外管局今日公布数据显示，4 月银行代客结售汇顺差 924 亿元人民币，为 2014 年 6 月以来最大顺差，3 月为逆差 165 亿元，1 至 4 月银行累计代客结售汇顺差 808 亿元。4 月银行结售汇顺差 669 亿元，3 月为逆差 580 亿元，1 至 4 月银行累计结售汇逆差 486 亿元。

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