

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

【2018-08-01】

今日央行发公告称，目前银行体系流动性总量处于较高水平，可吸收央行逆回购到期等因素的影响，不开展公开市场操作。逆回购到期 200 亿元，资金净回笼 200 亿元。Shibor 利率全数下跌，其中隔夜品种报 2.0280%，下跌 3.80 个基点；7 天品种报 2.6220%，下跌 2.60 个基点；1 个月品种报 2.9350%，下跌 3.00 个基点；3 个月品种报 3.1190%，下跌 5.50 个基点。今日央行继续暂停公开市场操作，资金面非常宽松，早盘隔夜资金大量融出，7 天及以上期限资金需求有限；午后成交集中在隔夜，宽松态势延续至尾盘。

今日发行的 5 年期、7 年期、10 年期农发行固息增发债中标利率分别为 3.7836%、4.1142%、4.1999%，全场倍数分别为 4.48 倍、3.22 倍、3.73 倍，边际倍数分别为 26.75 倍、1.25 倍、1.95 倍。今日发行的 3 年期、7 年期附息国债加权利率分别为 3.035%、3.4543%，边际利率分别为 3.0749%、3.4777%，全场倍数分别为 2.02 倍、2.25 倍，边际倍数分别为 3.21 倍、1.37 倍。

国债期货早盘小幅低开，随后探底回升，午后涨幅扩大。10 年期国债期货主力合约 T1809 收报 96.100，较上个交易日上涨 0.28%；5 年期国债期货主力合约 TF1809 收报 98.630，较上个交易日上涨 0.18%。昨晚中央政治局会议释放积极信息，但在财新制造业 PMI 不及预期、美国上调 2000 亿美元中国输美商品关税等传闻的影响下，今日国债期货大幅走强，现券收益率早盘小幅高开，随后一路向下。截至目前，剩余期限 9.53 年的国开债活跃券 180205 收益率报 4.165%/4.16%，剩余期限 9.80 年的国债活跃券 180011 收益率报 3.4625%/3.455%。

周三人民币兑美元中间价报 6.8293，较上个交易日下调 128 点。在岸人民币兑美元早盘拉升后迅速回落，午后震荡上升，涨幅扩大，截至 16:30，收报 6.7948，较上个交易日大幅上涨 307 点；离岸人民币兑美元早盘下行，午后收复部分失地，现报 6.8178，较上个交易日下跌 125 点，目前两岸汇差在 200 点附近。美元指数全天震荡偏强，午后稍有回落，现报 94.62，较上个交易日上涨 0.08%。

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