

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

【2018-06-04】

今日央行公开市场进行 200 亿元 7 天期、200 亿元 28 天期逆回购操作，今日逆回购到期 200 亿元，资金净投放 200 亿元。Shibor 利率短端下跌、长端上涨，其中隔夜品种报 2.5990%，下跌 20.20 个基点；7 天品种报 2.8180%，下跌 7.90 个基点；1 个月品种报 3.9930%，上涨 2.70 个基点；3 个月品种报 4.3410%，上涨 0.20 个基点。今日资金面总体均衡偏松，早盘大行融出少量隔夜，随后融出增多，隔夜资金逐渐宽松，下午有减点融出，7 天维持均衡态势，跨季资金需求旺盛。

今日发行的 3 年期、5 年期（130421Z）、5 年期（180408Z2）固息增发债中标利率分别为 4.268%、2.547%、4.4147%，全场倍数分别为 2.04 倍、4.4 倍、2.78 倍，边际倍数分别为 1.09 倍、3.88 倍、3.96 倍。国债期货低开低走，全线下跌。国债期货 10 年期国债期货主力合约 T1809 收报 94.640，较上个交易日下跌 0.22%；5 年期国债期货主力合约 TF1809 收报 97.580，较上个交易日下跌 0.14%。受央行扩大 MLF 担保品范围的影响，今日债市情绪谨慎，现券收益率震荡上行，截至目前，剩余期限 9.69 年的国开债活跃券 180205 收益率报 4.45%/4.4425%；剩余期限 9.67 年的国债活跃券 180004 收益率报 3.655%/3.645%。

周一人民币兑美元中间价报 6.4208，较上个交易日下调 130 点。在岸人民币兑美元早盘下跌后反弹，午间横盘整理，午后涨幅扩大，截至 16:30，在岸人民币兑美元收报 6.4123，较上一个交易日大幅上涨 46 点；离岸人民币兑美元早盘维持宽幅震荡，午后大幅拉升，现报 6.4022，较上一交易日上涨 119 点，两岸汇差倒挂在 73 点。美元指数震荡下行，现报 93.87，下跌 0.35%。

上周五（6 月 1 日）CFETS 人民币汇率指数录得 97.33，按周下行 0.30；参考 BIS 货币篮子的人民币汇率指数录得 100.60，按周下行 0.34，参考 SDR 货币篮子的人民币汇率指数录得 98.34，按周下行 0.26。

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