

市场概述 Market Overview

【每日市场动态 20180409】午后资金面有所收敛

文/ Ryan Rui

CFETS-NEX 2018/04/09

今日央行公开市场进行 100 亿元 7 天期逆回购操作，逆回购到期 400 亿元，资金净回笼 300 亿元。Shibor 利率除隔夜外全数下跌，其中隔夜品种报 2.5280%，上涨 8.20 个基点；7 天品种报 2.8060%，下跌 0.60 个基点；1 个月品种报 3.9701%，下跌 4.09 个基点；3 个月品种报 4.2579%，下跌 2.02 个基点。今日早盘银行间市场呈现宽松态势，银行类、非银加权大量融出隔夜资金，股份制、大行加权融出 7 天资金，大行加权融出 14 天资金，21 天融出较上周有所减少，更长期限交投不活跃，午后隔夜资金流动性稍有收紧，至尾盘资金面趋于均衡。

今日发行的 2 年期、5 年期农发行固息债中标利率分别为 4.13%、4.249%，全场倍数分别为 7.16 倍、3.02 倍，边际倍数分别为 1.51 倍、1.05 倍。国债期货高开高走，午后维持震荡，全线收涨。10

年期国债期货主力合约 T1806 收报 93.810，较上个交易日上涨 0.25%；5 年期国债期货主力合约 TF1806 收报 96.970，较上个交易日上涨 0.12%。今日资金面维持宽松，但较上周有所收敛，周日债市走强，今日现券收益率震荡反弹，截至目前，剩余期限 9.38 年的国开债活跃券 170215 收益率报 4.6325%/4.63%；剩余期限 9.57 年的国债活跃券 170025 收益率报 --%/3.70%。

周一人民币兑美元中间价报 6.3114，较上个交易日下调 188 点。在岸人民币兑美元早盘上涨后回落，午后跌幅扩大，临近尾盘再度回升，截至 16:30，在岸人民币兑美元收报 6.3107，较上个交易日收盘价下跌 108 点；离岸人民币兑美元早盘震荡上行，午间横盘整理，午后直线跳水下跌后小幅反弹，现报 6.3098，较上一交易日收盘价上涨 33 点，两岸汇

差目前维持在 2 点附近。美元指数早盘
全天维持窄幅震荡，现报 90.14，上涨
0.00%。

行 0.01。

上周三（4 月 4 日）CFETS 人民币汇
率指数录得 96.62，按周下行 0.11；参
考 BIS 货币篮子的人民币汇率指数录得
99.24，按周上行 0.07，参考 SDR 货币篮
子的人民币汇率指数录得 97.80，按周上

以上仅供参考，谢谢！

如果您对本文有任何评论和见解

请发电邮至：shmarketing@cfets-nex.com.cn

更多信息，请登录网站：www.cfets-nex.com.cn

免责声明

文中信息均来源于公开资料，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。