



【2018-07-20】

今日央行发布公告称，当前银行体系流动性合理充裕，今日不开展公开市场操作，无逆回购到期。 Shibor 利率全数下跌，其中隔夜品种报 2.3460%，较上个交易日内下跌 7.00 个基点；7 天品种报 2.6750%，下跌 0.80 个基点；1 个月品种报 3.1830%，下跌 1.50 个基点；3 个月品种报 3.5360%，下跌 2.50 个基点。今日资金面总体宽松。早盘隔夜即有大行减点融出，7 天期限有银行加权成交，需求较少，14 天期限银行有融入需求，21 天期限及以上成交较少，午后成交集中于隔夜。

今日发行的 91 天贴现国债加权利率为 2.3939%，边际利率为 2.4455%，全场倍数为 3.07 倍，边际倍数为 1.23 倍。今日发行的 30 年期附息国债中标利率为 3.97%，全场倍数为 1.68 倍，边际倍数为 1.3 倍。国债期货早盘震荡偏强，中午传闻资管新规将于本周落地，公募可投非标且允许银行自主整改，午后开盘国债期货直线跳水。10 年期国债期货主力合约 T1809 收报 95.605，较上个交易日大幅下跌 0.75%，创近一年半最大单日跌幅；5 年期国债期货主力合约 TF1809 收报 98.185，较上个交易日下跌 0.47%。早盘债市小幅走强，午后随着国债期货跳水，现券收益率大幅上行。截至目前，剩余期限 9.56 年的国开债活跃券 180205 收益率报 4.1825%/4.175%，剩余期限 9.84 年的国债活跃券 180011 收益率报 3.52%/3.51%。

周五人民币兑美元中间价报 6.7671，较上个交易日大幅下调 605 点，创“811”汇改以来最大调降幅度。 在岸、离岸人民币兑美元早盘大幅下跌，随后大幅走强，收复近全部失地，截至 16:30，收报 6.7795，较上个交易日下跌 65 点；离岸人民币兑美元一度跌破 6.83 关口，现报 6.7956，较上个交易日下跌 50 点，目前两岸汇差在 130 点附近。美元指数全天震荡，午后振幅扩大，现报 95.16，较上个交易日小幅下跌 0.04%。

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