



【2018-05-17】

今日央行公开市场进行 300 亿元 7 天期、200 亿元 14 天期逆回购操作，今日逆回购到期 200 亿，资金净投放 300 亿元。Shibor 利率短端下跌、长端上涨，其中隔夜品种报 2.5970%，下跌 16.90 个基点；7 天品种报 2.8030%，下跌 3.20 个基点；1 个月品种报 3.8310%，上涨 0.60 个基点；3 个月品种报 4.1010%，上涨 1.90 个基点。周四，银行间货币市场资金面维持均衡偏松态势。早盘政策性银行融出隔夜至 2 个月期限资金，股份制融出隔夜至 7 天期限资金，7 天期限机构需求堆积，临近午盘，各类机构需求多已得到满足；午后，机构减点资金融出增多，资金面宽松态势延续。

今日发行的 91 天期、3 年期、5 年期进出口行债中标利率分别为 2.7968%、4.3229%、4.4575%，全场倍数分别为 3.89 倍、2.36 倍、2.81 倍，边际倍数分别为 3.79 倍、1.55 倍、5.86 倍。下午发行的 5 年期、7 年期国开行固息增发债中标利率分别为 4.3407%、4.5782%，全场倍数分别为 3.51 倍、3.78 倍，边际倍数分别为 1.41 倍、1.54 倍。

国债期货早盘高开低走，随后维持横盘整理态势，午后大幅跳水，临近尾盘跌幅扩大。国债期货 10 年期国债期货主力合约 T1806 收报 93.915，较上个交易日下跌 0.19%；5 年期国债期货主力合约 TF1806 收报 97.450，较上个交易日下跌 0.23%。今日资金面维持宽松态势，但是海外债市持续走弱，美债收益率创七年新高，国内债市情绪偏谨慎，现券收益率早盘高开后震荡走升，截至目前，剩余期限 9.74 年的国开债活跃券 180205 收益率报 4.5575%/4.5525%；剩余期限 9.77 年的国债活跃券 180004 收益率报 3.72%/3.7075%。

周四人民币兑美元中间价报 6.3679，较上个交易日上调 66 点。在岸人民币兑美元早盘急涨，随后震荡回落，回吐部分涨幅，截至 16:30，在岸人民币兑美元收报 6.3671，较上一个交易日上涨 14 点，结束三日连跌；离岸人民币兑美元早盘小幅上行，随后全天震荡下跌，现报 6.3566，较上一交易日下跌 61 点，两岸汇差目前倒挂 100 点左右。美元指数早盘下跌后反弹，午后涨幅扩大，临近尾盘下跌，现报 93.36，下跌 0.02%。

中国央行今日下午公布数据显示，央行口径外汇占款余额实现四连增，4 月外汇占款余额增加 74.22 亿元人民币至 21.5 万亿元，上个月增加 78.38 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