

市场概述 Market Overview

【每日市场动态 20180514】资金面较上周有所收敛

文/ Ryan Rui

CFETS-NEX 2018/05/11

今日央行未进行公开市场逆回购操作，续作 1560 亿元 MLF，利率为 3.3%，较上次持平，此外央行发放 801 亿元抵押补充贷款（PSL）。今日无逆回购到期，逆回购资金零投放零回笼。Shibor 利率多数上涨，其中隔夜品种报 2.5800%，上涨 9.30 个基点；7 天品种报 2.7380%，上涨 2.50 个基点；1 个月品种报 3.8010%，上涨 0.20 个基点；3 个月品种报 4.0600%，上涨 1.00 个基点。

今日早盘政策性银行融出隔夜至 2 个月期限资金，大行、股份制融出加权隔夜，非银融出少量减点隔夜，存款类机构和非银均融入在加权位置；7 天期限资金有所收紧，存款类机构和非银融入加点融入；农商、城商和非银加点融出 14 天资金；整体而言，尽管央行等量续作 MLF 并同步投放 PSL，但在接下去月度缴税等因素冲击下，今日资金面较上周有所收

敛。

今日发行的 2 年期农发行固息增发债中标利率为 4.0515%，全场倍数为 3.19 倍，边际倍数为 2.24 倍。国债期货全天窄幅波动，全线微跌。10 年期国债期货主力合约 T1806 收报 94.105，较上个交易日下跌 0.01%；5 年期国债期货主力合约 TF1806 收报 97.770，较上个交易日下跌 0.05%。今日银行间市场资金面较上周有所收敛，国债期货全天弱势整理，市场情绪维持谨慎，现券收益率震荡上行，截至目前，剩余期限 9.75 年的国开债活跃券 180205 收益率报—%/4.525%；剩余期限 9.73 年的国债活跃券 180004 收益率报 3.70%/3.6925%。

周一人民币兑美元中间价报 6.3345，较上个交易日上调 179 点。在岸人民币兑美元早盘下跌，随后横盘整理，午后温和回升，截至 16:30，在岸人民币兑美

元收报 6.3368，较上一个交易日小幅下跌 17 点；离岸人民币兑美元早盘一路下行，随后全天震荡偏弱，现报 6.3302，较上一交易日上涨 52 点，目前两岸汇差倒挂在 60 点附近。美元指数早盘震荡偏强，午后下行，现报 92.33，下跌 0.27%。

上周五（5 月 11 日）CFETS 人民币汇率指数录得 97.59，按周上行 0.07；参考 BIS 货币篮子的人民币汇率指数录得 100.64，按周上行 0.20，参考 SDR 货币

篮子的人民币汇率指数录得 98.48，按周上行 0.26。

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。