

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

【2018-07-02】

今日央行发公告称，目前银行体系流动性总量处于较高水平，可吸收央行逆回购到期等因素的影响，不开展公开市场操作。逆回购到期 200 亿，资金净回笼 200 亿元。Shibor 利率全数下跌，其中隔夜品种报 2.5190%，下跌 10.90 个基点；7 天品种报 2.7800%，下跌 8.20 个基点；1 个月品种报 4.0040%，下跌 2.70 个基点；3 个月品种报 4.1040%，下跌 5.10 个基点。今日为跨季后的第一个交易日，资金面宽松，早盘便有减点隔夜融出，市场需求迅速被满足。7 天至 14 天资金融出较多，但需求相对较少，价格较上周有明显回落。1 个月以上期限成交较少，有少量机构有 3m 的融入需求。

国债期货早盘低开，随后探底回升，午后小幅收涨。10 年期国债期货主力合约 T1809 收报 96.090，较上个交易日上涨 0.13%；5 年期国债期货主力合约 TF1809 收报 98.555，较上个交易日上涨 0.10%。跨季后流动性更为宽松，主要期限资金价格明显走低，公布的 6 月官方制造业 PMI 和财新制造业 PMI 均较上个月回落，现券收益率明显下行。截至目前，剩余期限 9.61 年的国开债活跃券 180205 收益率报 4.21%/4.195%，剩余期限 9.88 年的国债活跃券 180011 收益率报 3.47%/--%。

周一人民币兑美元中间价报 6.6157，较上个交易日上涨 9 点，结束八连降。在岸人民币兑美元一路震荡走弱，连续跌破多个关口，截至 16:30，在岸人民币兑美元收报 6.6490，较上个交易日下跌 244 点，创 2017 年 10 月 27 日以来新低；离岸人民币兑美元同样大幅走弱，一度跌破 6.67 关口，现报 6.6674，较上个交易日下跌 320 点，目前两岸汇差在 135 点。美元指数全天维持强势，现报 94.76 点，上涨 0.26%。

上周五（6 月 29 日）CFETS 人民币汇率指数录得 95.66，按周下跌 1.72；参考 BIS 货币篮子的人民币汇率指数录得 99.00，按周下跌 1.64，参考 SDR 货币篮子的人民币汇率指数录得 95.89，按周下跌 1.75。

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