



【2018-05-21】

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，不进行公开市场操作。今日无逆回购到期，资金零投放零回笼。Shibor 利率涨跌互现，其中隔夜品种报 2.5270%，下跌 3.60 个基点；7 天品种报 2.7560%，下跌 1.20 个基点；1 个月品种报 3.8320%，下跌 0.10 个基点；3 个月品种报 4.1510%，上涨 0.40 个基点。今日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，非银和农商融出 14 天跨月资金，14 天至 21 天需求在上午便已得到满足；午后不乏减点隔夜资金融出，资金面呈现宽松态势。

今日发行的 2 年期农发行固息增发债中标利率为 4.0945%，全场倍数分别为 3.16 倍，边际倍数为 2.05 倍。国债期货早盘小幅低开，随后大幅拉升，午后横盘整理，全线收涨。国债期货 10 年期国债期货主力合约 T1809 收报 94.300，较上个交易日上涨 0.28%，创逾一个月最大涨幅；5 年期国债期货主力合约 TF1809 收报 97.445，较上个交易日上涨 0.07%。上周五美债收益率回落至 3.10% 下方，今日资金面继续维持宽松态势，现券收益率长端下行明显，截至目前，剩余期限 9.73 年的国开债活跃券 180205 收益率报 4.525%/4.5175%；剩余期限 9.71 年的国债活跃券 180004 收益率报 3.70%/3.68%。

周一人民币兑美元中间价报 6.3852，较上个交易日下调 89 点，为 1 月 24 日以来新低。在岸人民币兑美元一路走跌，午后跌幅有所扩大，截至 16:30，在岸人民币兑美元收报 6.3888，较上一个交易日下跌 128 点，创 1 月 23 日以来新低；离岸人民币兑美元走势低迷，全天震荡下跌，现报 6.3772，较上一交易日下跌 147 点，两岸汇差目前倒挂 116 点左右。美元指数震荡偏强，一度突破 94 整数关口，现报 93.93，上涨 0.25%。

上周五（5 月 18 日）CFETS 人民币汇率指数录得 97.88，按周上涨 0.29；参考 BIS 货币篮子的人民币汇率指数录得 101.12，按周上涨 0.48，参考 SDR 货币篮子的人民币汇率指数录得 98.58，按周上涨 0.10。

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