

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

【2018-08-20】

今日央行开展 1200 亿元 7 天期逆回购操作，无逆回购到期，资金净投放 1200 亿元。Shibor 利率全数上涨，其中隔夜品种报 2.6250%，上涨 4.50 个基点；7 天品种报 2.6740%，上涨 2.40 个基点；1 个月品种报 2.6760%，上涨 2.30 个基点；3 个月品种报 2.8300%，上涨 1.30 个基点。今日早盘资金面偏紧，大行融出隔夜较少，股份制银行融入隔夜，7 天期限非银融出价格较高，至午间资金面趋于均衡，午后维持宽松状态。

国债期货早盘小幅高开，随后直线跳水，由涨转跌，短暂触底后又快速拉升翻红，午后延续震荡态势。10 年期国债期货主力合约 T1812 收报 94.590，较上个交易日上涨 0.19%；5 年期国债期货主力合约 TF1812 收报 97.580，较上个交易日上涨 0.03%；2 年期国债期货主力合约 TS1812 收报 99.215，上涨 0.08%。今日资金面延续收敛态势，债券市场小幅震荡，现券收益率小幅上行。截至目前，剩余期限 9.48 年的国开债活跃券 180205 收益率报 4.285%/4.275%，剩余期限 9.75 年的国债活跃券 180011 收益率报 3.65%/--%。

周一人民币兑美元中间价报 6.8718，较上个交易日上调 176 点。在岸人民币兑美元早盘拉升后一路上行，午间小幅回落，午后温和反弹，截至 16:30，在岸人民币兑美元收报 6.8525，较上个交易日收盘价大幅上涨 290 点；离岸人民币兑美元弱势震荡，现报 6.8418，较上个交易日收盘价下跌 68 点，目前两岸汇差倒挂在 100 点附近。美元指数全天震荡上行，现报 96.27，较上个交易日上涨 0.15%。

上周五（8 月 17 日）CFETS 人民币汇率指数录得 92.78，按周下行 0.13，参考 BIS 货币篮子的人民币汇率指数录得 96.22，按周上行 0.01，参考 SDR 货币篮子的人民币汇率指数录得 92.86，按周下行 0.23。

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