

市场概述 Market Overview

【每日市场动态 20180420】资金面维持偏紧态势

文/ Vivian Shen

CFETS-NEX 2018/04/20

今日央行开展中央国库现金管理商业银行定期存款操作 800 亿元，无逆回购到期，资金净投放 800 亿。Shibor 利率短端上涨，长端下跌，其中隔夜品种报 2.7470%，上涨 1.40 个基点；7 天品种报 2.8930%，上涨 0.90 个基点；1 个月品种报 3.7610%，下跌 3.00 个基点；3 个月品种报 4.0170%，下跌 3.30 个基点。

周五银行间市场资金面全天维持紧势，早盘机构融出较昨日增多，但价格依旧高企，7 天以上资金买盘较少，21 至 1 个月成交不多，临近午盘大行有所融出，流动性有略微转松迹象，下午资金面依旧偏紧，但价格较上午降低，临近尾盘大行增加融出，机构头寸基本得以借平。

今日财政部发行的 91 天期贴现国债加权中标利率为 2.6242%，边际利率为 2.7218%，全场倍数为 2.87 倍，边际倍数为 1.67 倍，30 年期附息国债中标利率

为 4.0031%，全场倍数为 1.91 倍，边际倍数为 1.04 倍。

国债期货早盘低开高走，临近午盘回落，午后先攀升后下跌。10 年期国债期货主力合约 T1806 收报 95.075，较上个交易日下跌 0.03%；5 年期国债期货主力合约 TF1806 收报 97.950，较上个交易日下跌 0.02%。今日现券收益率震荡下行，截至目前，剩余期限 9.81 年的国开债活跃券 180205 收益率报 4.36%/4.35%；剩余期限 9.79 年的国债活跃券 180004 收益率报—%/3.5175%。

周五人民币兑美元中间价报 6.2897，较上个交易日下调 65 点。在岸人民币兑美元全天一路下行，截至 16:30，在岸人民币兑美元收报 6.2898，较上一个交易日下跌 120 点，创逾一周新低。离岸人民币兑美元全天维持震荡偏弱，现报 6.2836，较上一交易日下跌 64 点，两岸

汇差目前倒挂在 89 点附近。美元指数全天震荡走强，现报 90.10，涨 0.23%。

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。