

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

【2018-08-06】

今日央行发布公告称，目前银行体系流动性总量处于较高水平，可吸收金融机构缴存法定存款准备金等因素的影响，不开展逆回购操作，今日无逆回购到期，资金零投放零回笼。Shibor 利率全数下跌，其中隔夜品种报 1.8190%，下跌 3.00 个基点；7 天品种报 2.4690%，下跌 5.60 个基点；1 个月品种报 2.7910%，下跌 4.60 个基点；3 个月品种报 2.9540%，下跌 4.90 个基点。今日资金面延续宽松，早盘大行融出大量隔夜至 14 天的减点资金，7-14 天期限资金需求不多，更长期限资金需求较少，午后资金面维持宽松态势。

今日发行的 3 年期、5 年期农发行固息增发债中标利率分别为 3.4214%、3.6614%，全场倍数分别为 3.84 倍、4.08 倍，边际倍数分别为 1.48 倍、1.07 倍。国债期货早盘维持整理态势，尾盘跳水收跌。10 年期国债期货主力合约 T1809 收报 96.080，较上个交易日下跌 0.11%；5 年期国债期货主力合约 TF1809 收报 98.565，较上个交易日下跌 0.10%。今日资金面延续宽松，现券收益率曲线趋陡，长端收益率小幅下行，短端收益率下行明显。截至目前，剩余期限 9.52 年的国开债活跃券 180205 收益率报 4.12%/4.115%，剩余期限 9.79 年的国债活跃券 180011 收益率报 3.48%/3.45%。

周一人民币兑美元中间价报 6.8513，较上个交易日下调 191 点。在岸人民币兑美元早盘双双大幅上涨，随后全天一路下行，涨幅收窄，截至 16:30，在岸人民币兑美元收报 6.8420，较上个交易日收盘价上涨 200 点；离岸人民币兑美元由涨转跌，午后跌幅扩大，现报 6.8583，较上个交易日下跌 108 点，目前两岸汇差在 130 点附近。美元指数震荡走势，现报 95.32，较上个交易日上涨 0.11%。

上周五（8 月 3 日）CFETS 人民币汇率指数录得 92.69，按周下行 0.26；参考 BIS 货币篮子的人民币汇率指数录得 95.98，按周下行 0.23，参考 SDR 货币篮子的人民币汇率指数录得 92.91，按周下行 0.29。

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