

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

【2018-08-17】

今日央行开展 900 亿元 7 天期逆回购操作，无逆回购到期，资金净投放 900 亿元。Shibor 利率全数上涨，其中隔夜品种报 2.5800%，上涨 6.90 个基点；7 天品种报 2.6500%，上涨 1.30 个基点；1 个月品种报 2.6530%，上涨 1.40 个基点；3 个月品种报 2.8170%，上涨 0.40 个基点。今日资金面较昨日收紧，早盘大行少量融出隔夜，价格上行，7 天、1 个月价格也有所上行，午后有银行融出资金，资金面趋于宽松。

财政部今日发行的 91 天期贴现国债中标利率为 2.0885%，边际利率为 2.1534%，全场倍数为 2.46 倍，边际倍数为 1.69 倍；发行的 30 年期附息国债中标利率为 4.2232%，全场倍数为 1.7 倍，边际倍数为 2.26 倍。

国债期货早盘早盘窄幅震荡，临近午盘跳水走弱，午后再度跳水，刷新近三个月新低，随后跌幅有所收涨。10 年期国债期货主力合约 T1812 收报 94.485，较上个交易日下跌 0.23%；5 年期国债期货主力合约 TF1812 收报 97.620，较上个交易日下跌 0.07%；2 年期国债期货主力合约 TS1812 收报 99.160，下跌 0.20%。今日资金面明显收紧，叠加黑色系期货价格走高、地方债供给压力增加，以及国债招标结果不及预期，现券收益率上行明显，尾盘涨幅有所收窄。截至目前，剩余期限 9.49 年的国开债活跃券 180205 收益率报 4.27%/4.2625%，剩余期限 9.76 年的国债活跃券 180011 收益率报 3.65%/--%。

周五人民币兑美元中间价报 6.8894，较上个交易日上调 52 点。在岸人民币兑美元早盘下行，午间横盘整理，午后探底回升，截至 16:30，在岸人民币兑美元收报 6.8815，较上个交易日收盘价上涨 145 点；离岸人民币兑美元早盘下跌后维持震荡，午后有所拉升，跌幅收窄，现报 6.8658，较上个交易日收盘价下跌 43 点，目前两岸汇差倒挂在 150 点附近。美元指数早盘下跌，随后小幅震荡上行，午后跳水走弱，现报 96.43，较上个交易日下跌 0.15%。

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