



【2021-06-07】

今日央行开展 100 亿逆回购操作，有 100 亿逆回购到期，当日资金零投放零回笼。Shibor 利率多数上行，其中隔夜品种报 2.2990%，上涨 12.40 个基点；7 天品种报 2.2530%，上涨 6.60 个基点；1 个月品种报 2.3850%，上涨 0.80 个基点；3 个月品种报 2.4460%，上涨 0.20 个基点。早盘资金面均衡偏紧，大行国股暂无融出，午后大行国股开始部分融出，资金面趋松。

今日上午海关总署公布了 5 月贸易数据，数据显示，以美元计价，5 月进口同比增速为 51.1%，前值为 43.1%，预期为 53.5%；出口同比增速为 27.9%，前值为 32.3%，预期为 32.1%。下午人民银行公布了 5 月外汇储备数据，数据录得为 32218 亿美元，前值为 31981.8 亿美元，预期为 32150 亿美元。

今日下午发行的 3 年期、5 年期农发行固息增发债中标利率分别为 3.0071%、3.2363%，全场倍数分别为 4.70 倍、4.26 倍，边际倍数分别 1.26 倍、1.00 倍。国债期货低开后低位震荡。10 年期国债期货主力合约 T2109 收报 97.815，较上个交易日下跌 0.23%；5 年期国债期货主力合约 TF2109 收报 99.680，较上个交易日下跌 0.15%；2 年期国债期货主力合约 TS2109 收报 100.170，较上个交易日下跌 0.06%。今日现券收益率震荡上行。截至目前，剩余期限 9.74 年的国开债活跃券 210205 收益率报 3.5425/3.5425%，剩余期限 9.45 年的国债活跃券 200016 收益率报 3.1375%/3.1351%。

周一美元兑人民币中间价报 6.3963，较上个交易日下调 109 点。今日在岸美元兑人民币低开后低位震荡，下午 3 点 30 分后跌幅扩大。截至 16:30，在岸美元兑人民币收报 6.3961，较上一交易日贬值 131 个基点；离岸美元兑人民币震荡上行，下午 3 点 30 分后涨幅迅速收窄，现报 6.3931，较上一交易日升值 29 个基点，目前两岸汇差倒挂在 30 点附近。美元指数全天震荡上行，下午 3 点后涨幅有所收窄，现报 90.21，较上个交易日升值 0.08%。

上周最后一个交易日（6 月 4 日）CFETS 人民币汇率指数录得 97.82，按周下跌 0.13；参考 BIS 货币篮子的人民币汇率指数录得 101.88，按周下跌 0.17；参考 SDR 货币篮子的人民币汇率指数录得 96.72，按周下跌 0.08。

以上仅供参考，谢谢！

文/Jason Mao

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