



【2020-08-07】

今日央行开展了 100 亿元 7 天期逆回购操作，有 200 亿元逆回购到期，资金净回笼 100 亿元。Shibor 利率多数上涨，其中隔夜品种报 2.0570%，较上个交易日上涨 39.60 个基点；7 天品种报 2.2050%，较上个交易日上涨 13.10 个基点；1 个月品种报 2.2860%，较上个交易日持平；3 个月品种报 2.6030%，较上个交易日上涨 0.30 个基点。今日早盘大行融出少量隔夜后即报平盘，14 天以内期限需求旺盛，资金面呈均衡偏紧态势。午后各类机构重新开始融出 7 天以内期限，尾盘资金面恢复宽松。

今日公布的数据显示，中国 7 月外汇储备 31543.9 亿美元，前值 31123.3 亿美元。

今日早间发行的 5 年期、7 年期国开行跨市场金融增发债中标利率分别为 2.9555%、3.2407%，全场倍数分别为 5.39 倍、7.93 倍、边际倍数分别为 1.25 倍、7.33 倍。随后发行的 1 年期、2 年期进出口行固息债中标利率分别为 2.5776%、2.9500%，全场倍数分别为 3.54 倍、3.09 倍，边际倍数分别为 4.89 倍、1.19 倍。同时发行的 30 年期付息国债中标利率为 3.7735%，全场倍数为 2.67 倍，边际倍数为 1.96 倍，91 天期贴现国债加权中标

利率为 2.0703%，边际利率为 2.1696%，全场倍数为 1.92 倍，边际倍数为 2.28 倍。国债期货早盘震荡下行，午盘短暂上行后回落，随后维持震荡。10 年期国债期货主力合约 T2009 收报 98.795，较上个交易日下跌 0.09%，5 年期国债期货主力合约 TF2009 收报 100.440，较上个交易日下跌 0.02%；2 年期国债期货主力合约 TS2009 收报 100.545，较上个交易日上涨 0.01%。受二季度央行货币政策执行报告表述偏鹰等因素影响，现券收益率早盘高开，临近午盘受中美紧张局势影响，收益率有所回落。截至目前，剩余期限 9.86 年的国开债活跃券 200210 收益率报 3.5150%/3.5100%，剩余期限 9.79 年的国债活跃券 200006 收益率报 2.9850%/2.9000%。

周五人民币兑美元中间报价 6.9408，较上个交易日上调 30 点。在岸、离岸人民币兑美元早盘震荡下行，随后小幅回升，截至 16:30，在岸人民币兑美元收报 6.9598，下跌 157 点。离岸人民币兑美元现报 6.9608，较上个交易日收盘价下跌 172 点，目前两岸汇差在 10 点附近。美元指数全天震荡上行，现报 93.09，较上个交易日上涨 0.32%。

以上仅供参考，谢谢！

文/Julia Ji

如果您对本文有任何评论与见解
请发電郵至: SHResearch@cfets-nex.com.cn

扫描二维码 轻松查看更多资讯



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