



【2020-06-05】

今日央行开展了 1500 亿元 7 天期逆回购操作，有 3000 亿逆回购到期，资金净回笼 1500 亿元。Shibor 利率多数上涨，其中隔夜品种报 1.5820%，较上个交易日下跌 38.10 个基点；7 天品种报 1.9870%，较上个交易日下跌 1.40 个基点；1 个月品种报 1.5820%，较上个交易日上涨 6.90 个基点；3 个月品种报 1.5940%，较上个交易日上涨 5.80 个基点。今日资金面整体趋松，隔夜至 7 天期限全天供给充足，1 个月跨季期限稍显紧张。

今日发行的国开行 3 年期、5 年期 LPR 浮息债中标利率分别为 2.8500%、3.1000%，全场倍数分别为 3.46 倍、3.54 倍，边际倍数分别为 2.85 倍、1.16 倍。随后发行的 1 年期、2 年期、7 年期进出口行固息增发债中标利率为 2.2500%、2.5679%、3.3671%，全场倍数分别为 2.35 倍、2.38 倍、3.95 倍，边际倍数分别为 1.71 倍、1.07 倍、15 倍。随后发行的 91 天期、182 天期贴现国债加权中标利率分别为 1.7836%、1.9286%，边际利率分别为 1.8698%、2.0155%，全场倍数分别为 3.69 倍、3.14 倍，边际倍数分别为 1.09 倍、19 倍。国债期货全天震荡下行。10 年期国债期货主力合约 T2009 收报 99.845，较上个交易日下

跌 0.26%；5 年期国债期货主力合约 TF2009 收报 101.380，较上个交易日下跌 0.25%；2 年期国债期货主力合约 TS2009 收报 101.015，较上个交易日下跌 0.10%。今日早盘现券收益率上行明显，午盘短暂回落后再度上升，截至目前，剩余期限 9.76 年的国开债活跃券 200205 收益率报 3.1600%/3.1550%，剩余期限 9.46 年的国债活跃券 190015 收益率报 --/ 2.8375%。

周五人民币兑美元中间报价 7.0965，较上个交易日上调 47 点。在岸人民币兑美元早盘高开，全天震荡上行，截至 16:30，在岸人民币兑美元收报 7.0866，较上个交易日官方收盘价上涨 357 点。离岸人民币兑美元全天震荡走强，现报 7.0859，较上个交易日收盘价上涨 229 点，目前两岸汇差倒挂在 7 点附近。美元指数早盘震荡下行，午后有所回升，现报 96.64，较上个交易日下跌 0.13%。

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
请发电邮至：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