



【2020-04-07】

今日央行发公告称，目前银行体系流动性总量处于合理充裕水平，不开展逆回购操作。今日逆回购到期 700 亿元，资金净回笼 700 亿元。Shibor 利率全线下跌，其中隔夜品种报 0.8060%，较上个交易日下跌 19.50 个基点；7 天品种报 1.7730%，较上个交易日下跌 5.80 个基点；1 个月品种报 1.6590%，较上个交易日下跌 8.20 个基点；3 个月品种报 1.7300%，较上个交易日下跌 11.40 个基点。今日资金面全期限全天宽松，大行股份制减点融出隔夜。

今日发行的 1 年期、3 年期、7 年期国开行固息增发债中标利率为 1.2632%、1.8600%、2.7826%，全场倍数分别为 4.43 倍、4.89 倍、8.74 倍，边际倍数分别为 8.46 倍、25 倍、7.06 倍。同时发行的 182 天期国开行贴现金融债中标利率为 1.1619%，全场倍数为 5.78 倍。边际倍数为 3.89 倍。下午在上交所发行的 2 年期农发行固息增发债中标利率为 1.6595%，全场倍数为 4.21 倍，边际倍数为 4.44 倍。国债期货早盘高开，震荡走强，午后小幅回落。10 年期国债期货主力合约 T2006 收报 102.305，较上个交易日上涨 0.72%；5 年期国债期

货主力合约 TF2006 收报 103.340，较上个交易日上涨 0.93%；2 年期国债期货主力合约 TS2006 收报 102.110，较上个交易日上涨 0.50%。受上周五央行定向降准和意外下调超额存款准备金利率等因素影响，今日债市大幅走强，午后涨幅有所收窄，其中中短久期现券收益率下行幅度尤为明显。截至目前，剩余期限 9.45 年的国开债活跃券 190215 收益率报 2.9800%/2.9625%，剩余期限 9.62 年的国债活跃券 190015 收益率报 2.5175%/2.5050%。

周二人民币兑美元中间报价 7.0939，较上个交易日上调 165 点。在岸、离岸人民币兑美元双双全天震荡走强，截至 16:30，在岸人民币兑美元收报 7.0550，较上个交易日官方收盘价上涨 353 点。离岸人民币兑美元现报 7.0676，较上个交易日收盘价上涨 396 点，目前两岸汇差在 126 点附近。美元指数全天震荡下跌，现报 100.17，较上个交易日下跌 0.63%。

上周最后一个交易日(4月3日)CFETS人民币汇率指数录得 94.24，按周下降 0.32；参考 BIS 货币篮子的人民币汇率指数录得 97.77，按周下降 0.2；参考 SDR 货币篮子的人民币汇率指数录得 91.53，按周下降 0.54。

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