

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

【2018-09-04】

今日央行发布公告称，目前银行体系流动性总量处于较高水平，不开展逆回购操作。今日无逆回购到期，资金零投放零回笼。Shibor 利率全数下跌，其中隔夜品种报 2.1950%，下跌 8.20 个基点；7 天品种报 2.6000%，下跌 2.10 个基点；1 个月品种报 2.7060%，下跌 1.00 个基点；3 个月品种报 2.8780%，下跌 0.90 个基点。今日资金面整体宽松，早盘大行融出隔夜，融入需求较少，需求很快满足，7 天融入需求有限，午后资金面依旧宽松，有大行减点融出隔夜。

今日发行的 1 年期、3 年期、5 年期国开行固息增发债中标利率分别为 2.9699%、3.68%、3.9605%，全场倍数分别为 4.4 倍、3.73 倍、2.44 倍，边际倍数分别为 2.67 倍、3.51 倍、3.47 倍。国债期货早盘小幅高开，随后震荡走弱，午后跌幅扩大。10 年期国债期货主力合约 T1812 收报 94.795，较上个交易日下跌 0.12%；5 年期国债期货主力合约 TF1812 收报 97.730，较上个交易日下跌 0.12%；2 年期国债期货主力合约 TS1812 收报 99.280，较上个交易日下跌 0.04%。今日资金面延续宽松，银行间债券市场持续清淡，收益率全天窄幅波动，变化不大。截至目前，剩余期限 9.84 年的国开债活跃券 180210 收益率报 4.215%/4.205%，剩余期限 9.70 年的国债活跃券 180011 收益率报 3.62%/3.605%。

周二人民币兑美元中间价报 6.8183，较上个交易日上调 164 点。在岸人民币兑美元早盘冲高回落，午间横盘整理，午后跌幅扩大，截至 16:30，在岸人民币兑美元收报 6.8290，较上个交易日收盘价下跌 125 点；离岸人民币兑美元早盘上涨，随后全天一路下行，一度跌破 6.85 关口，现报 6.8500，较上个交易日收盘价下挫 149 点，目前两岸汇差在 180 点附近。美元指数早盘涨幅温和收窄，午后大幅拉升，现报 95.52，较上个交易日大幅上涨 0.42%。

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