



【2018-09-10】

今日央行发布公告称，目前银行体系流动性总量处于合理充裕水平，不开展公开市场操作。Shibor 利率多数上行，其中隔夜品种报 2.5730%，下跌 1.80 个基点；7 天品种报 2.6790%，上涨 0.60 个基点；1 个月品种报 2.7230%，上涨 1.10 个基点；3 个月品种报 2.8420%，下跌 0.90 个基点。今日资金面较上个交易日整体偏紧，早盘大行融出少量隔夜资金，中小行存在隔夜需求，资金面趋于紧张，7 天融出较多，14 天及以上需求有限，银行、非银融入 1 个月跨季资金。午后大行有补头寸需求，资金面紧张持续到尾盘。

国家统计局今早公布数据显示，主要受食品价格上涨影响，8 月 CPI 同比 2.3%，高于预期的 2.1%和前值 2.1%，CPI 环比 0.7%，高于前值的 0.3%；而受受环保限产等影响，黑色金属冶炼和压延加工业涨幅扩大的影响，8 月 PPI 同比 4.1%，高于预期的 4%，但低于前值 4.6%，PPI 环比 0.4%，前值为 0.1%。

国债期货小幅低开，随后震荡走低，午后横盘整理。10 年期国债期货主力合约 T1812 收报 94.420，较上个交易日下跌 0.22%；5 年期国债期货主力合约 TF1812 收报 97.450，较上个交易日下跌 0.17%；2 年期国债期货主力合约 TS1812 收报 99.250，较上个交易日下跌 0.02%。今日资金面继续收敛，CPI 同比走高，国债期货走弱，现券收益率明显上行。截至目前，剩余期限 9.83 年的国开债活跃券 180210 收益率报 4.295%/4.29%，剩余期限 9.68 年的国债活跃券 180011 收益率报 3.67%/3.62%。

周一人民币兑美元中间价报 6.8389，较上个交易日下调 177 点。在岸人民币兑美元早盘走弱后，全天小幅波动，横盘整理，截至 16:30，在岸人民币兑美元收报 6.8655，较上个交易日收盘价下跌 276 点；离岸人民币兑美元维持弱势，现报 6.8737，较上个交易日收盘价下跌 45 点，两岸汇差目前在 110 点附近。美元指数早盘走强，午后冲高后直线跳水，现报 95.32，较上个交易日下跌 0.10%。

上周五（9 月 7 日）CFETS 人民币汇率指数录得 93.52，按周上涨 0.44；参考 BIS 货币篮子的人民币汇率指数录得 97.06，按周上涨 0.37，参考 SDR 货币篮子的人民币汇率指数录得 92.95，按周上涨 0.20。

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