市场概述
Market Overview

【每日市场动态 20170904】人民币兑美元升破 6.52

文/ Ryan Rui

CFETS-NEX 2017/09/04

央行今日继续暂停公开市场操作，逆回购到期 1400 亿，资金净回笼 1400 亿。Shibor 利率涨跌互现，其中隔夜品种报 2.7500%，下跌 6.30 个基点；7 天品种报 2.8572%，下跌 1.92 个基点；1 个月品种报 3.9032%，上涨 1.12 个基点；3 个月品种报 4.4023%，上涨 2.82 个基点。尽管央行持续净回笼，但月初银行间市场资金面依旧维持宽松，早盘即有大行融出隔夜资金，需求基本得到满足，午后隔夜资金大量减点融出，7 天买盘较多，跨季资金需求旺盛，融出有限。

今日发行的 3 年期、5 年期农发行中标收益率分别为 4.2611%、4.3260%，全场倍数分别为 2.71、3.03 倍。整体而言，今日两期农发债中标收益率接近市场预期，投标倍数尚可，机构需求一般。

国债期货早盘低开，临近午盘逐渐走强，尾盘再度走低，全天维持弱势震荡格局，10 年期国债期货主力合约 T1712 收报 94.695，跌 0.06%，5 年期国债期货主力合约 TF1712 收报 97.480，跌 0.05%。周末朝鲜核试验引发海外市场避险情绪上升，但在经济基本面持续改善以及货币基金监管新规等冲击下，债市依旧承压，现券收益率小幅上行，截至目前，剩余期限 9.60 年的国开债活跃券 170210 收益率报 4.3875%/4.385%；剩余期限 9.92 年的国债活跃券 170018 收益率报 3.6525%/3.6425%。

周一人民币兑美元中间价报 6.5668，较上个交易日大幅上调 241 点，为连续第 6 日调升。在岸人民币兑美元震荡走强，涨幅不断扩大，日内连破 6.55、6.54、6.53、6.52 四大关口，截至 16:30，在岸人民币兑美元报收 6.5200，创近 16 个月新高，较上一交易日收盘价上涨 479 点；离岸人民币兑美元同样大

幅走强，升破 6.53 关口，现报 6.5274，较上一交易日收盘价大涨 333 点，两岸汇差目前在 60 点附近。美元指数维持弱势震荡，现报 92.50，较上一交易日收盘价下跌 0.38%。

上周五（9 月 1 日）CFETS 人民币汇率指数录得 94.42，按周上涨 0.66；参考 BIS 货币篮子的人民币汇率指数录得 95.18，按周上涨 0.69，参考 SDR 货币篮子的人民币汇率指数录得 95.37，按周上涨 0.61。

以上仅供参考，谢谢！

如果您对本文有任何评论和见解

请发电邮至：shmarketing@cfets-nex.com.cn

更多信息，请登录网站：www.cfets-nex.com.cn

免责声明 文中信息均来源于公开资料，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。