

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

【2018-09-05】

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，可吸收金融机构缴存法定存款准备金等因素的影响，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 利率多数下跌，其中隔夜品种报 2.1640%，下跌 3.10 个基点；7 天品种报 2.5520%，下跌 4.80 个基点；1 个月品种报 2.6960%，下跌 1.00 个基点；3 个月品种报 2.8500%，下跌 2.80 个基点。今日资金面总体宽松，早盘大行减点融出隔夜，融入需求可以满足，7 天资金融出较多，有大行融入 14 天期限，1 个月期限跨季资金融出较多但需求有限，午后资金依旧宽松，随着部分银行融入隔夜资金，资金面一度趋紧，需求满足后逐渐恢复宽松。

今日发行的 3 年期、7 年期附息国债中标利率分别为 3.3018%、3.6022%，边际利率分别为 3.3272%、3.63%，全场倍数分别为 2.32 倍、1.95 倍，边际倍数分别为 1.08 倍、1.46 倍。下午发行的 1 年期、7 年期、10 年期农发行固息增幅债中标利率分别为 2.9185%、4.304%、4.3783%，全场倍数分别为 5.14 倍、2.55 倍、2.94 倍，边际倍数分别为 16.25 倍、1 倍、13.61 倍，总体而言，今日农发债招标结果较好，1 年期限需求旺盛。

国债期货早盘震荡偏强，午后短暂冲高后，持续回落，由涨转跌。10 年期国债期货主力合约 T1812 收报 94.690，较上个交易日下跌 0.09%；5 年期国债期货主力合约 TF1812 收报 97.675，较上个交易日下跌 0.05%；2 年期国债期货主力合约 TS1812 收报 99.275，较上个交易日持平。今日公布的财新服务业 PMI 录得 51.5，远低于预期，刷新 10 个月新低，美对中 2000 亿关税即将落地，不过债券市场未受提振，现券收益率全天窄幅波动。截至目前，剩余期限 9.83 年的国开债活跃券 180210 收益率报 4.21%/4.205%，剩余期限 9.70 年的国债活跃券 180011 收益率报 3.63%/3.62%。

周三人民币兑美元中间价报 6.8266，较上个交易日下调 83 点。在岸、离岸人民币兑美元全天维持弱势，一路下行，截至 16:30，在岸人民币兑美元收报 6.8381，较上个交易日收盘价下跌 91 点；离岸人民币接连跌破 6.85、6.86 关口，现报 6.8598，较上个交易日收盘价下挫 102 点，目前两岸汇差在 230 点附近。美元指数早盘温和下行，午盘起大幅拉升，现报 95.56，较上个交易日上涨 0.13%。

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