

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

【2018-08-27】

今日央行发布公告称，考虑月末财政支出、中央国库现金管理操作可对冲政府债券发行缴款、央行逆回购到期等因素的影响，为维护银行体系流动性合理充裕，不开展逆回购操作。央行和财政部进行 1000 亿元 3 个月期国库现金定存招标，中标利率为 3.80%，较上次上涨 10BP。今日逆回购到期 1200 亿，资金净回笼 200 亿元。Shibor 利率多数上涨，其中隔夜品种报 2.4400%，上涨 4.80 个基点；7 天品种报 2.6420%，上涨 3.00 个基点；1 个月品种报 2.7510%，上涨 1.30 个基点；3 个月品种报 2.8950%，上涨 0.60 个基点。今日资金面总体较上周五更加宽松，早盘隔夜减点融出，7 天资金需求有限，14 天及以上期限需求较少，午后资金面维持宽松，大行加权融出部分隔夜资金。

据国家统计局今早发布数据显示，1-7 月中国规模以上工业企业利润同比增长 17.1%，较前值略微回调 0.1%。7 月规模以上工业企业利润同比增长 16.2%，增速下滑 3.8%，创二季度以来新低。规模以上工业企业中，国有控股企业实现利润同比增长 30.5%，增速排名第一，股份制企业实现利润增长 21.3%，位列第二。7 月末，规模以上工业企业总资产同比增长 7.4%，资产负债率为 56.6%，与去年同期相比降低 0.5 个百分点，其中国有控股企业资产负债率为 59.4%，同比降低 1.3 个百分点，为 2016 年以来最低水平。

今日发行的 3 年期、5 年期农发行固息增发债中标利率分别为 3.7424%、3.9991%，全场倍数分别为 3.34 倍、2.72 倍，边际倍数分别为 1.12 倍、1.33 倍。国债期货早盘低开，随后震荡上升，午后震荡回落，小幅收跌。10 年期国债期货主力合约 T1812 收报 94.620，较上个交易日下跌 0.01%；5 年期国债期货主力合约 TF1812 收报 97.610，较上个交易日下跌 0.04%；2 年期国债期货主力合约 TS1812 收报 99.270，下跌 0.06%。今日资金面整体宽松，现券跟随国债期货，收益率早盘高开，全天震荡走升。截至目前，剩余期限 9.87 年的国开债活跃券 180210 收益率报 4.24%/4.23%，剩余期限 9.73 年的国债活跃券 180011 收益率报 3.64%/--%。

周一人民币兑美元中间价报 6.8508，较上个交易日上调 202 点。在岸人民币兑美元早盘小幅下行，午盘收复失地，午后维持弱势震荡，截至 16:30，在岸人民币兑美元收报 6.8171，较上个交易日收盘价上涨 618 点；离岸人民币兑美元早盘下跌，随后全天弱势震荡，现报 6.8076，较上个交易日收盘价上涨 20 点，目前两岸汇差倒挂在 337 点附近。美元指数早盘一路上行，午后涨幅缩小，现报 95.21，较上个交易日上涨 0.04%。

上周五（8 月 24 日）CFETS 人民币汇率指数录得 92.77，按周下行 0.01；参考 BIS 货币篮子的人民币汇率指数录得 96.26，按周上行 0.04，参考 SDR 货币篮子的人民币汇率指数录得 92.62，按周下行 0.24。

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