

市场概述 Market Overview

【每日市场动态 20170911】人民币兑美元大幅走弱

文/ Ryan Rui

CFETS-NEX 2017/09/11

今日央行未进行逆回购操作，逆回购到期 400 亿，资金净回笼 400 亿。Shibor 利率涨少跌多，其中隔夜品种报 2.6440%，上涨 0.80 个基点；7 天品种报 2.8014%，下跌 0.09 个基点；1 个月品种报 3.9339%，下跌 0.31 个基点；3 个月品种报 4.4034%，下跌 2.47 个基点。今日资金面延续上周宽松态势，早盘伊始即有大行融出，流动性宽裕，早盘过后，宽松态势稍有收敛，卖盘融出较上午略有减少，长期限资金利率有所下降。

今日发行的 3 年期、5 年期农发行固息增发债中标收益率分别为 4.2204%、4.2941%，全场倍数分别为 2.88、2.60 倍。总体而言，两期农发债招标结果尚可，中标收益率略高于市场预测均值，需求一般。

国债期货全天走势低迷，尾盘加速下行，全线收跌。10 年期国债期货主力合

约 T1712 收报 95.045，跌 0.13%，5 年期国债期货主力合约 TF1712 收报 97.625，跌 0.11%。今日资金面较上周略有收敛，现券收益率早盘窄幅震荡，午后小幅上行，截至目前，剩余期限 9.58 年的国开债活跃券 170210 收益率报 4.335%/4.33%；剩余期限 9.91 年的国债活跃券 170018 收益率报 3.6175%/3.615%。

周一人民币兑美元中间价报 6.4997，较上个交易日上调 35 点，为 2005 年汇改以来最长调升记录。央行取消购汇准备金以及下调外汇风险准备金率后，人民币涨势放缓，在岸离岸人民币对兑美元双双均大跌，截至 16:30，在岸人民币兑美元报收 6.5239，较上一交易日收盘价大跌 622 点，创今年 1 月以来最大单日跌幅；离岸人民币兑美元同样震荡走弱，现报 6.5274，较上一交易日收盘价下挫 244 点，两岸汇差目前在 30 点附近。

美元指数走势偏强，全天维持高位震荡，现报 91.45，较上一交易日收盘价涨 0.14%。

上周五（9月8日）CFETS 人民币汇率指数录得 95.16，按周上涨 0.74；参考 BIS 货币篮子的人民币汇率指数录得 95.82，按周上涨 0.64，参考 SDR 货币篮子的人民币汇率指数录得 96.20，按周上

涨 0.83。

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。