



【2018-09-03】

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，可吸收政府债券发行缴款等因素的影响，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 2.2770%，下跌 3.20 个基点；7 天品种报 2.6210%，下跌 1.20 个基点；1 个月品种报 2.7160%，下跌 0.40 个基点；3 个月品种报 2.8870%，下跌 0.70 个基点。今日资金面较上周五有所收敛，但总体仍较宽松，早盘大行加权融出较多隔夜资金，午后隔夜有减点融出，临近尾盘有融入需求，需求很快满足，其他期限融出较多。

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 3.7413%、4.0254%，全场倍数分别为 2.97 倍、2.31 倍，边际倍数分别为 1.17 倍、2.09 倍。国债期货早盘小幅低开，随后横盘整理，午后持续走弱，尾盘收跌。10 年期国债期货主力合约 T1812 收报 94.925，较上个交易日下跌 0.19%；5 年期国债期货主力合约 TF1812 收报 97.850，较上个交易日下跌 0.15%；2 年期国债期货主力合约 TS1812 收报 99.330，较上个交易日下跌 0.06%。月初资金面依旧宽松，早盘公布的财新制造业 PMI 不及预期，不过债券市场呈现弱势，收益率小幅上行。截至目前，剩余期限 9.84 年的国开债活跃券 180210 收益率报 4.215%/4.2125%，剩余期限 9.70 年的国债活跃券 180011 收益率报 3.61%/3.57%。

周一人民币兑美元中间价报 6.8347，较上个交易日上调 101 点。在岸人民币兑美元早盘下跌，午后持续走强，由跌转涨，截至 16:30，在岸人民币兑美元收报 6.8165，较上个交易日收盘价上涨 134 点；离岸人民币兑美元全天一路上行，现报 6.8319，较上个交易日收盘价上涨 129 点，目前两岸汇差在 120 点附近。美元指数早盘震荡偏弱，午后小幅冲高回落，现报 95.11，较上个交易日下跌 0.02%。

上周五（8 月 31 日）CFETS 人民币汇率指数录得 93.08，按周上行 0.31；参考 BIS 货币篮子的人民币汇率指数录得 96.69，按周上行 0.43，参考 SDR 货币篮子的人民币汇率指数录得 92.75，按周上行 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