



【2018-09-17】

今日央行公开市场开展 MLF 操作 2650 亿元，利率与上期持平，无逆回购到期，资金净投放 2650 亿元。Shibor 利率多数下跌，其中隔夜品种报 2.4660%，下跌 2.30 个基点；7 天品种报 2.6390%，下跌 0.60 个基点；1 个月品种报 2.7490%，下跌 0.70 个基点；3 个月品种报 2.8220%，下跌 0.80 个基点。今日资金面较上周收敛。早盘流动性均衡偏松，临近午盘，隔夜融出逐渐减少，午后大行纷纷开始补头寸，机构融入需求旺盛，流动性呈现紧张格局。此外，跨月资金价格较上周有所下降。

国债期货早盘高开，MLF 操作公布后小幅拉升，随后全天维持横盘整理态势。10 年期国债期货主力合约 T1812 收报 94.550，较上个交易日上涨 0.10%；5 年期国债期货主力合约 TF1812 收报 97.665，较上个交易日上涨 0.11%；2 年期国债期货主力合约 TS1812 收报 99.345，较上个交易日上涨 0.05%。今日资金面较上周明显收敛，不过受月内第二次 MLF 操作的提振，国债期货小幅收涨，现券收益率小幅下行。截至目前，剩余期限 9.80 年的国开债活跃券 180210 收益率报 4.225%/4.2225%，剩余期限 9.67 年的国债活跃券 180011 收益率报 3.64%/3.63%。

周一人民币兑美元中间价报 6.8509，较上个交易日下调 147 点。在岸、离岸人民币兑美元全天横盘震荡，截至 16:30，在岸人民币兑美元收报 6.8690，较上一个交易日下跌 169 点；离岸人民币兑美元现报 6.8744，较上个交易日上涨 57 点，两岸汇差在 40 点附近。美元指数早盘震荡偏弱，午后冲高回落，现报 94.79，下挫 0.19%。

上周五（9 月 14 日）CFETS 人民币汇率指数录得 93.05，按周下行 0.47；参考 BIS 货币篮子的人民币汇率指数录得 96.67，按周下行 0.39，参考 SDR 货币篮子的人民币汇率指数录得 92.55，按周下行 0.40。

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