

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

【2018-09-07】

今日央行公开市场开展 MLF 操作 1765 亿元，利率与上期持平，MLF 到期 1765 亿元，资金零投放零回笼。Shibor 利率全数上涨，其中隔夜品种报 2.5910%，上涨 9.70 个基点；7 天品种报 2.6730%，上涨 4.00 个基点；1 个月品种报 2.7120%，上涨 1.20 个基点；3 个月品种报 2.8510%，上涨 0.60 个基点。今日银行间市场资金面边际收敛，早盘隔夜资金偏紧，融出甚少，整体呈现供不应求态势，临近午盘，流动性趋于均衡，午后隔夜资金卖盘增多，资金面趋于宽松，尾盘更有机机构减点融出隔夜资金。其他期限方面，7 天价格上涨，1 个月跨月资金以非银融出为主，价格偏高。

今日发行的 91 天期、182 天期贴现国债加权中标利率分别为 2.1254%、2.5413%，边际中标利率分别为 2.1696%、2.5839%，全场倍数分别为 2.32 倍、2.43 倍，边际倍数分别为 1.7 倍、1.05 倍。国债期货低开低走，午后维持震荡，小幅收跌。10 年期国债期货主力合约 T1812 收报 94.685，较上个交易日下跌 0.09%；5 年期国债期货主力合约 TF1812 收报 97.650，较上个交易日下跌 0.07%；2 年期国债期货主力合约 TS1812 收报 99.255，较上个交易日下跌 0.03%。今日央行等量续作 MLF，资金面继续边际收敛，债券市场交投维持清淡，现券收益率小幅走高。截至目前，剩余期限 9.83 年的国开债活跃券 180210 收益率报 4.2175%/4.215%，剩余期限 9.69 年的国债活跃券 180011 收益率报 3.65%/--%。

周五人民币兑美元中间价报 6.8212，较上个交易日上调 5 点。在岸人民币兑美元早盘一路下行，午后反弹，收复部分失地，截至 16:30，在岸人民币兑美元收报 6.8379，较上个交易日收盘价下跌 72 点；离岸人民币兑美元早盘下行，午后小幅冲高后回落，现报 6.8472，较上个交易日收盘价下跌 25 点，目前两岸汇差在 85 点附近。美元指数全天一路下行，午后下行幅度增大，跌破 95 关口，现报 94.90，较上个交易日下跌 0.15%。央行下午公布数据显示，8 月中国外汇储备录得 31097.2 亿美元，低于预期的 31150 亿美元，前值为 31179.5 亿美元，环比减少 82.3 亿美元，结束此前两个月连升。

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