

市场概述

Market Overview

【每日市场动态 20170908】人民币创近 22 个月新高

文/ Ryan Rui

CFETS-NEX 2017/09/08

今日央行未进行逆回购操作，亦无逆回购到期。Shibor 利率涨跌互现，其中隔夜品种报 2.6360%，下跌 0.46 个基点；7 天品种报 2.8023%，下跌 0.33 个基点；1 个月品种报 3.9370%，上涨 0.35 个基点；3 个月品种报 4.4281%，下跌 0.67 个基点。今日银行间市场资金面较昨日相似，交易以隔夜、七天为主，早盘即有各类机构融出隔夜资金，需求基本得到满足，午后资金面继续维持宽松态势，但隔夜期限较昨日略有收敛，跨季资金依旧融出价高，需求有限。

今早财政部发行的 91 天期、182 天期贴现国债加权中标收益率分别 2.9633%、3.3395%，边际中标收益率分别为 3.0798%、3.4372%，全场倍数分别为 1.92、2.38 倍，边际倍数分别为 2.35、1.52 倍。

国债期货早盘高开，随后平稳走强。

10 年期国债期货主力合约 T1712 收报 95.155，涨 0.26%，5 年期国债期货主力合约 TF1712 收报 97.730，涨 0.15%。现券收益率早盘延续昨日情绪大幅下行，随后回吐部分涨幅，午后维持震荡，截至目前，剩余期限 9.59 年的国开债活跃券 170210 收益率报 4.315%/4.305%；剩余期限 9.91 年的国债活跃券 170018 收益率报 3.605%/3.595%。当前市场流动性总体维持平稳，但对于 9 月资金面仍心存担忧，国家统计局将于周六公布 8 月 CPI 和 PPI 数据，市场预测值分别 1.60% 和 5.70%，前值为 1.40%、5.50%。

周五人民币兑美元中间价报 6.5032，较上个交易日大幅上调 237 点，为连续第 10 日调升。在岸人民币兑美元大幅走强，一度升破 6.44 关口，截至 16:30，在岸人民币兑美元报收 6.4617，创 2015 年 12 月 15 日以来新高，较上一交易日

收盘价上涨 355 点；离岸人民币兑美元同样大幅上涨，午后回吐部分涨幅，现报 6.4688，较上一交易日收盘价大幅上涨 177 点，两岸汇差目前在 135 点附近。美元指数持续走弱，午后稍有反弹，现报 91.27，较上一交易日收盘价跌 0.27%。

今早公布的出口数据同比有所回落，显示 8 月外需仍有放缓迹象，且人民币的明显升值也一定程度上抑制出口数据；

进口同比上升，主要是由于内需强劲、人民币升值以及大宗价格持续上扬。

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。