



【2020-08-17】

今日央行开展了 500 亿元 7 天期逆回购操作及 7000 亿元中期借贷便利（MLF）操作，有 100 亿元逆回购及 4000 亿元中期借贷便利（MLF）到期，全口径资金净投放 3400 亿元。Shibor 利率短端下跌、长端上涨，其中隔夜品种报 2.1280%，较上个交易日下跌 4.70 个基点；7 天品种报 2.2130%，较上个交易日下跌 0.90 个基点；1 个月品种报 2.3050%，较上个交易日下跌 0.10 个基点；3 个月品种报 2.6020%，较上个交易日上涨 0.10 个基点。今天早盘资金面呈均衡偏松态势，国股大行适

量融出，午后资金面持续宽松至收盘。

今日午后发行的 3 年期、5 年期、10 年期农发行固息增发债中标利率分别为 3.0728%、3.2965%、3.3656%，全场倍数分别为 4.37 倍、4.04 倍、6.86 倍，边际倍数分别为 13.36 倍、3.12 倍、1.80 倍。国债期货早盘高开，全天高位震荡。10 年期国债期货主力合约 T2009 收报 99.560，较上个交易日上涨 0.10%，5 年期国债期货主力合约 TF2009 收报 100.885，较上个交易日上涨 0.12%；2 年期国债期货主力合约 TS2009 收报 100.685，较上个交易日上涨 0.02%。早盘受央行超量续作本月 MLF 等因素影响，现券收益率下行，午后随着国债期货由涨转跌，现券收益率有所回升。截至目前，剩余期限 9.84 年的国开债活跃券 200210 收益率报 3.4325%/3.4325%，剩余期限 9.76 年的国债活跃券 200006 收益率报 2.96%/2.93%。

周一人民币兑美元中间报价 6.9362，较上个交易日上调 43 点。在岸、离岸人民币兑美元早盘双双震荡走高，午后有所回落，截至 16:30，在岸人民币兑美元收报 6.9417，较上个交易日上涨 81 点。离岸人民币兑美元现报 6.9385，较上个交易日收盘价上涨 35 点，目前两岸汇差倒挂在 32 点附近。美元指数早盘震荡走低，午后快速拉升，收复全部失地，现报 93.12，较上个交易日上涨 0.03%。

上周最后一个交易日（8 月 14 日）CFETS 人民币汇率指数录得 92.32，按周上涨 0.29；参考 BIS 货币篮子的人民币汇率指数录得 96.08，按周上涨 0.31；参考 SDR 货币篮子的人民币汇率指数录得 90.48，按周上涨 0.33。

以上仅供参考，谢谢！

文/Neal Tao

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