市场概述
每日市场动态

常规报告系列

上海国际货币经纪
Shanghai CFETS-NEX International Money Broking

【2020-09-07】

今日央行开展了 1000 亿元 7 天期逆回购操作，有 800 亿元逆回购到期，逆回购资金净投放 200 亿元。Shibor 利率多数上涨，其中隔夜品种报 2.0880%，较上个交易日上涨 3.60 个基点；7 天品种报 2.2000%，较上个交易日下跌 1.10 个基点；1 个月品种报 2.4360%，较上个交易日上涨 3.70 个基点；3 个月品种报 2.6760%，较上个交易日上涨 1.50 个基点。今日资金面呈均衡宽松态势，早盘隔夜期限供给少量，14 天以上期限有大行融出，午后资金面持续均衡宽松态势至收盘。

今日海关总署发布数据显示，中国 8 月出口（以人民币计）同比增 11.6%，预期增 12.4%，前值增 10.4%；进口同比降 0.5%，预期增 6.1%，前值增 1.6%。8 月（以美元计）出口同比增 9.5%，预期增 8.3%，前值增 7.2%；进口降 2.1%，预期增 0.4%，前值降 1.4%。8 月贸易顺差 4165.9 亿元，预期 3860 亿元，前值 4422.3 亿元。8 月外汇储备 31646.1 亿美元，前值 31543.9 亿美元，为连续 5 个月上升。

今日早间发行的 3 年期、5 年期、10 年期农发行固息增发债中标利率分别为 3.3312%、3.6061%、3.5574%，全场倍数分别为 9.81 倍、4.74 倍、7.86 倍，边际倍数分别为 6.25 倍、2.71 倍、1.47 倍。国债期货早盘持续低位窄幅震荡，尾盘跌幅扩大后触底反弹，10 年期国债期货主力合约 T2012 收报 97.590，较上个交易日下跌 0.13%；5 年期国债期货主力合约 TF2012 收报 99.380，较上个交易日下跌 0.04%；2 年期国债期货主力合约 TS2012 收报 100.060，较上个交易日下跌 0.01%。早盘现券收益率震荡上行，午后再度下行。截至目前，剩余期限 9.78 年的国开债活跃券 200210 收益率报 3.705%/3.69%，剩余期限 9.71 年的国债活跃券 200006 收益率报 3.15%/3.1314%。

周一人民币兑美元中间报价 6.8386，较上个交易日下调 27 点。在岸、离岸人民币兑美元全天震荡，截至 16:30，在岸人民币兑美元收报 6.8302，较上个交易日官方收盘价上涨 91 点。离岸人民币兑美元现报 6.8322，较上个交易日收盘价上涨 38 点，目前两岸汇差在 20 点附近。美元指数震荡上行，北京时间下午 3 点后有所回落，现报 92.84，较上个交易日上涨 0.02%。

上周最后一个交易日（9 月 4 日）CFETS 人民币汇率指数录得 93.52，按周上涨 0.58；参考 BIS 货币篮子的人民币汇率指数录得 97.25，按周上涨 0.51；参考 SDR 货币篮子的人民币汇率指数录得 91.58，按周上涨 0.53。

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。