

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

【2019-09-02】

今日央行发公告称，目前银行体系流动性总量处于较高水平，可吸收政府债券发行缴款等因素的影响，无逆回购到期，资金零投放零回笼。Shibor 利率多数下跌，其中隔夜品种报 2.5500%，较上个交易日下跌 2.20 个基点；7 天品种报 2.6530%，较上个交易日下降 1.20 个基点；1 个月品种报 2.6610%，较上个交易日持平；3 个月品种报 2.7000%，较上个交易日下跌 0.10 个基点。今日月初隔夜资金面全天呈现宽松态势，尾盘仍有大行融出；7 天至 14 天期限融出需求较多，整体表现宽松；21 天以及更长期限全天成交较少。

今日发行的 3 年期、5 年期农发行固息增发债中标利率分别为 2.9861%、3.3019%，全场倍数分别为 4.87 倍、4.14 倍，边际倍数分别为 4.00 倍、1.33 倍。国债期货早盘小幅走高回落，午后低位持续震荡。10 年期国债期货主力合约 T1912 收报 98.775，较上个交易日下降 0.19%；5 年期国债期货主力合约 TF1912 收报 99.925，较上个交易日下降 0.09%；2 年期国债期货主力合约 TS1912 收报 100.275，较上个交易日下降 0.02%。受中美关税按预期落地影响，今日现券收益率震荡上行。截至目前，剩余期限 9.72 年的国开债活跃券 190210 收益率报 3.4925%/3.4850%，剩余期限 9.72 年的国债活跃券 190006 收益率报 --/3.0650%。

周一人民币兑美元中间报价 7.0883，较上个交易日下调 4 点。在岸人民币兑美元早盘震荡持稳，午后下行，截至 16:30，在岸人民币兑美元收报 7.1716，较上个交易日官方收盘价下跌 264 点。离岸人民币兑美元早盘震荡走强，午盘持稳，14:15 左右起走弱，现报 7.1770，较上一交易日下跌 153 点，目前两岸汇差在 54 点附近。美元指数早盘波动持稳，14:40 左右起震荡上行，现报 98.97，较上个交易日上涨 0.13%。

上周最后一个交易日（8 月 30 日）CFETS 人民币汇率指数录得 91.20，按周下降 0.42；参考 BIS 货币篮子的人民币汇率指数录得 94.82，按周下降 0.37；参考 SDR 货币篮子的人民币汇率指数录得 91.01，按周下降 0.40。

以上仅供参考，谢谢！

文/Dshlin Dong

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