

市场概述

Market Overview

【晨报 20151116】

文/ Frank Sun

CFETS ICAP

CFETS-ICAP 2015/11/16

1. 财经要闻

(1) 10 月金融机构外汇占款转为净流入。10 月金融机构外汇占款增加 129 亿元人民币，扭转此前连续 4 个月减少势头；当月央行口径外汇占款也走出八连降，增加 533.37 亿元。据央行的金融机构人民币信贷收支表，全口径下 10 月末金融机构外汇占款余额较上月末增加 0.05%；此前至 9 月份连续 3 个月刷新单月最大降幅。

(2) 上交所、深交所将融资保证金比例从 50%提高至 100%。上交所、深交所对融资融券交易实施细则进行修改，将投资者融资买入证券时的融资保证金最低比例由 50%提高至 100%。自 11 月 23 日起实施。此外，证监会决定，自 2015 年 11 月 16 日起，放宽股指期货日买卖数量限制，投机型股指期货日交易量由 10 手上调为 100 手，交易佣金由万分之二十下调至万分之一。

2. 市场动态

(1) 资金成本小幅下行。上周五，隔夜质押式回购加权平均利率为 1.7970%，上日为 1.8051%；7 天品种为 2.3417%，上日为 2.3504%。

(2) 上周五，利率债收益率整体小幅下行，国债收益率曲线短端波动不大，中长端有所下行。早盘新发 3m、6m 国债，3m 招标收益率较低，6m 招标收益率与前一日市场收益率水平较为接近。农发增发 1.5.10 年期，招标收益率与前一日市场收益率差别不大。截至日终，国开债收益率整体下行约 1-2BP，非国开债收益率除个别期限外，整体下行 1BP 左右。

(3) 人民币创一个半月新低。人民币兑美元即期周五小幅收跌，与九连跌的中间价同创一个半月新低。交易员称，中企信用违约风险引爆，加重人民币贬值预期，多日积累的购汇盘集中爆发，美元空头承压被迫止损。

离岸人民币更是重挫至逾一个半月低位，两地价差扩至近 400 点子。香港财资协会公布的数据显示，11 月 13 日美元/人民币（香港）即期汇率定盘价为

6.4121。

3. 评级变动（无）

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-icap.com.cn

更多信息，请登录网站：www.cfets-icap.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。