

市场概述

Market Overview

【每日市场动态 20161101】10 月 PMI 创年内新高

文/ Zora Zhang

CFETS-ICAP 2016/11/01

周二央行公开市场共进行 1900 亿逆回购操作，其中 7 天 1000 亿、14 天期 600 亿、28 天期 300 亿，逆回购到期 1550 亿，资金净投放 350 亿，为 10 月 19 日以来的连续第 10 次净投放。今日 Shibor 利率涨跌互现，隔夜 Shibor 跌 0.1 个基点报 2.2520%；7 天 Shibor 跌 0.2 个基点报 2.4160%；14 天 Shibor 与上日持平，报 2.5730%；1 个月 Shibor 涨 0.33 个基点报 2.7486%；3 个月 Shibor 涨 0.21 个基点报 2.8254%。今日银行间市场资金面较为宽松，早盘就有大行融出隔夜资金，需求立刻得到满足。午后各期限资金仍供给充裕，资金面全天维持均衡偏松态势。

今日国家统计局公布 10 月份制造业 PMI 为 51.2，比上月上升 0.8，创 2014 年 8 月以来新高，大幅好于预期；非制造业 PMI 为 54，比上月上升 0.3。分项指标中，生产、需求、库存、价格全面

回升。分规模看，大型企业微幅回落、仍处荣枯线以上，中、小型企业显著回升但仍在线下。

今日发行的 10 年期、20 年期国开行固息增发债中标收益率分别为 3.0904%、3.359%，全场倍数分别为 4.32、3.3 倍，边际倍数分别为 5.26、1.34 倍。整体而言，今日国开行债招标尚可，各期限中标利率接近市场预测区间上限，投标倍数超 3 倍。今日 10 年期国债期货主力合约 T1612 收报 101.33 元，涨 0.06%；5 年期国债期货主力合约 TF1612 收盘报 101.755 元，涨 0.05%。现券收益率在 PMI 超预期公布后略有上行，之后小幅下行，尾盘渐趋稳定，剩余期限 9.43 年的国开债活跃券 160210 收益率报 3.1425%/3.135%；剩余期限 9.76 年的国债活跃券 160017 收益率报 2.73%/2.725%。

周二人民币兑美元中间价报 6.7734 元，较昨日下调 93 点。今日距离 10 月 1

日人民币正式纳入 SDR 以来已经过去了一个月的时间，人民币走向国际化的进程正在加速。自纳入 SDR 后，人民币汇率有所贬值，不过市场对此表现平稳，对于人民币的调整幅度接受程度也有所变高。在岸人民币兑美元早盘小幅走弱，午后小幅上涨后再度走弱，截止 16:30，在岸人民币兑美元收报 6.7744 元，较上一个交易日收盘价跌 36 点。受制造业 PMI 数据超预期推动，离岸人民币兑

美元一度逆转跌势，现报 6.7820 元，较上个交易日收盘跌 42 个点，两岸汇差目前在 76 点附近；今日美元指数走势偏弱，现报 98.25，跌 0.10%。

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。