

市场概述

Market Overview

【每日市场动态 20160204】资金面宽松延续

文/ Ryan Rui

CFETS-ICAP 2016/02/04

央行周四投放 14 天期、28 天期逆回购分别 800 亿和 700 亿，中标利率分别为 2.4% 和 2.6%，均与上次持平，今日市场有 800 亿逆回购到期，市场资金净投放 700 亿。银行间市场资金面延续近期的宽松态势，流动性充足。截止到今日 16:45，银行间信用拆借 IB0001 品种报 1.9946%，IB0007 品种报 2.5492%。交易员称，市场整体成交量继续下降，市场内如农商行等中小银行因临近春节交易意愿清淡，大行和股份制银行资金提供仍较多，预计节前行情将延续。

银行间债市周三现券收益率整体下跌，剩余期限 9.70 年的国债活跃券 150023 收益率报 2.87%，小幅下降约 4 个基点，剩余期限 9.60 年的国开债活跃券 150218 收益率报 3.17%，小幅下降 2.25 个基点。信用债方面利差走扩，超 AAA 级中票短融收益率整体下行约 3 个基点，AA 级的中票短融整体上行约 20 个基

点。10 年期国债期货主力合约 T1603 收盘报 100.07 元，涨 0.13%，5 年期国债期货主力合约 TF1603 收盘报 100.62 元，涨 0.07%。交易员称，春节前流动性充足，资金面宽松，债市逐步企稳，之前债市的调整情绪已经出现消散的迹象。

外汇市场，昨日美元指数大跌，美联储杜德利昨日的表态降低了市场对于美联储未来加息步伐的预期，美元大跌。即期美元兑人民币盘中小幅下跌，整体波动平稳，中间价因美元大跌而升约百点，创近一个月新高，今日美元兑人民币央行中间价为 6.5419，截止到周四 16:45，美元兑离岸人民币报 6.6135，美元兑在岸人民币报 6.5775。交易员称，美国经济趋弱，加息预期降温，小幅缓解了人民币的贬值预期，早盘主动结汇盘不少，成交量亦继续放大。虽然市场对春节前人民币汇率稳定的看法保持一致，但是人民币期权隐含波动率仍显示

人民币走势的不确定性。

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。