

市场概述

Market Overview

【每日市场动态 20161124】美元指数突破 102 关口

文/ Ryan Rui

CFETS-ICAP 2016/11/24

央行公开市场今日进行 600 亿 7 天期、450 亿 14 天期、以及 100 亿 28 天期逆回购操作，逆回购到期 2000 亿，资金净回笼 850 亿，终结连续 9 个交易日资金净投放；今日 Shibor 利率连续第 11 个交易日全线上涨，其中隔夜品种报 2.2820%，较上一交易日上涨 0.50 个基点，7 天品种报 2.4520%，涨 0.10 个基点，1 个月品种报 2.8199%，涨 1.10 个基点，3 个月品种报 2.9956%，涨 0.99 个基点。今日银行间市场早盘隔夜、7 天品种资金融出有限，维持偏紧态势，市场需求难以得到满足，午后大行等机构隔夜融出逐渐增加，但资金融出时间较前两日有所后延，尾盘市场趋于均衡。

国债期货延续弱势震荡，小幅收跌，10 年期国债期货主力合约 T1703 收报 99.695 元，跌 0.11%；5 年期国债期货主力合约 TF1703 收盘报 100.645 元，跌

0.02%。现券交投热情较昨日有所冷却，收益率维持震荡，稍有走低，截至目前，剩余期限 9.37 年的国开债活跃券 160210 收益率报 3.21%/3.205%；剩余期限 9.70 年的国债活跃券 160017 收益率报 2.86%/2.855%。

连续多日大幅剧烈调整后，近两日现券迎来技术性反弹，收益率略有走低，短期来看，人民币汇率依旧承压，资金面易紧难松，资金价格难有明显回落，同时当前黑色系远期合约大涨，再加上近期降温降雪，通胀上升担忧升温，短期债市维持谨慎。

周四人民币兑美元中间价报 6.9085 元，较上一个交易日下调 181 点，为 2008 年 6 月以来首度跌破 6.9 关口。在岸人民币兑美元开盘跌破 6.92 关口，随后在 6.92 附近窄幅震荡，截止 16:30 收报 6.9189 元，较上一个交易日日盘收盘

价重挫 261 点；离岸人民币兑美元早盘跌破 6.96，刷新记录新低，随后大幅反弹，一度收复 6.95 关口，午后再度逼近 6.96 后反弹上涨，现报 6.9450 元，较上一个交易日收盘价上涨 92 点，两岸汇差目前在 260 点附近；美元指数震荡上行，走势强势，午后一度冲破 102 关口，创逾 13 年新高，现报 101.82，涨约 0.16%。

昨晚公布的美国 10 月耐用品订单初值创 2015 年 10 月以来新高，11 月密歇根大学消费者信心指创今年 5 月来最高，同时美联储 11 月纪要显示认为应相对快

的加息。美元指数的持续上升，对人民币汇率造成较大的压力。环球银行金融电信协会今早数据显示，10 月人民币在全球支付中占比 1.67%，前值为 2.03%，使用占比降至第六。

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。