

市场概述

Market Overview

【每日市场动态 20160930】祝大家国庆小长假快乐

文/ Ryan Rui

CFETS-ICAP 2016/09/30

节前最后一天央行公开市场进行 300 亿 14 天期、100 亿 28 天期逆回购操作，逆回购到期 900 亿，资金净回笼 500 亿，本周央行累计资金净回笼 4250 亿（不含央行票据到期）；今日 Shibor 利率涨跌互现，其中隔夜品种报 2.3270%，较上一交易日上涨 13.90 个基点，7 天品种报 2.4770%，下跌 1 个基点，1 个月品种报 2.7410%，下跌 0.2 个基点，3 个月品种报 2.8015%，较上一个交易日持平。今日银行间市场资金面整体平稳，14 天资金供需基本均衡，隔夜、7 天期限资金机构融出意愿不高。

今日债券市场人气冷清，交投寥寥，国债期货早盘略微下探后震荡走强，午后稍有回落，10 年期国债期货主力合约 T1612 收报 101.190 元，涨 0.02%；5 年期国债期货主力合约 TF1612 收盘报 101.625 元，涨 0.02%。现券收益率全天

几无变动，剩余期限 9.52 年的国开债活跃券 160210 收益率报 3.125%/3.12%；剩余期限 9.85 年的国债活跃券 160017 收益率报 2.72%/2.71%。

今日公布的 9 月财新制造业 PMI 为 50.1，前值为 50。这也是 2015 年 2 月以来，该数据第二次落入扩张区间，在分项中，新订单指数和采购库存指数较上月上涨，产出指数则较上月下滑，但仍位于扩张区间，表明 9 月我国制造业轻微扩张，经济面较 8 月小幅改善，但改善幅度有限，制造业仍面临下滑风险。

周五人民币兑美元中间价报 6.6778 元，下调 78 点，创两周来最弱。在岸人民币兑美元早盘缩量微跌，随后窄幅整理，截止 15:15，在岸人民币兑美元报 6.6700 元；离岸人民币兑美元同样小幅走弱，现报 6.6810 元，较上个交易日收盘价下跌 68 点，两岸汇差目前在 110 点

附近；美元指数冲高回落，现报 95.65，
涨 0.13%。外汇交易中心今早发表文章称，
人民币即将正式加入 SDR 货币篮子之际，
国际投资者配置人民币债券资产的需求
进一步增加，相应带来资本流入，将助力人民币
汇率保持稳定。

国际货币祝大家国庆节快乐~

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。