

市场概述

Market Overview

【每日市场动态 20160205】央妈红包不断

文/ Ryan Rui

CFETS-ICAP 2016/02/05

央行周五投放 14 天期、28 天期逆回购分别 600 亿和 900 亿，今日到期 200 亿，市场资金净投放 1300 亿。银行间市场资金面延续近期的宽松态势，流动性充足。7 天期信用拆借 IB0007 报 2.500%，下跌 30bp，14 天期信用拆借 IB0014 报 2.800%，下跌 20bp。春节前市场流动性稳定，资金融出方较多，融入较少，春节前市场交易情绪低迷，成交量较明显缩减。

银行间债市周三现券整体涨跌互现，国债短期限的收益率有小幅下跌，长期限的收益率小幅上涨，而国开债短期限收益率小幅上涨，长期限收益率小幅下行。信用债方面，超 AAA 级中票短融收益率继续小幅下跌，AA+级中票短融收益率继续上涨。信用债利差继续走扩。截止到下午 16:30，剩余期限 9.70 年的国债活跃券 150023 收益率报 2.87%，小幅上涨约 0.09 个基点，剩余期限 9.60 年

的国开债活跃券 150218 收益率报 3.12%，下跌 5.11 个基点。10 年期国债期货主力合约 T1603 收盘报 100.295 元，涨 0.05%；5 年期国债期货主力合约 TF1603 收盘报 100.775 元，涨 0.05%。春节前流动性充足，今日央行大批量释放流动性，资金面宽松，但临近春节，交易意愿下降，不同评级的债券利差分歧较大。

外汇市场美元兑人民币今日中间价报 6.5314 元，较昨日调高 0.16%，为近一个月以来最强水平。即期美元兑人民币周三早盘在 6.5692 附近窄幅波动，午后，美元兑人民币小幅下探到 6.5660 后回至 6.5692 附近波动，美元兑人民币走势平稳。截止到下午 16:30，离岸人民币今日最高报 6.5826，最低报 6.5650。部分机构春节前已经停止交易，市场成交量较小，交投清淡。央行副行长、外管局局长潘功胜今日下午表示，当前中国经济仍运行在合理区间。当前中国国

际收支状况基本平稳，跨境资本流动风险总体可控。人民币汇率对一篮子货币保持了基本稳定，不存在持续贬值的基础，不会走资本管制的“老路”。

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。