

市场概述

Market Overview

【每日市场动态 20160914】Shibor 利率全线上涨

文/ Zora Zhang

CFETS-ICAP 2016/09/14

今日央行公开市场进行 700 亿元 7 天期逆回购、300 亿元 14 天期逆回购、650 亿元 28 天期逆回购。另外，公开市场今日有 300 亿元逆回购到期，资金净投放 1350 亿元；今日 Shibor 利率全线上涨，其中隔夜 Shibor 利率涨 2 个基点报 2.1280%，连续八日上涨；7 天 Shibor 涨 0.65 个基点报 2.3920%；14 天 Shibor 涨 0.25 个基点报 2.5190%；3 个月 Shibor 涨 0.35 个基点报 2.7885%。今日银行间市场资金持续昨日的紧张势态，早盘仅有 7 天 14 天和更长期限资金高价融出，紧张的局面一直延续到下午收盘前缓解。虽然央行公开市场保持逾千亿元净投放，但中秋及国庆双节需求增多，且例行缴准以及节后缴税备付导致供给偏少。央行继续组合运用 7/14/28 天逆回购平抑资金面波动。

今日发行的 2 年期、5 年期附息国债

加权中标收益率分别为 2.3257%、2.5266%，接近此前 2.33%、2.53% 的预测均值，边际收益率分别为 2.3483%、2.5543%。全场倍数分别为 3.75、2.79 倍，边际倍数分别为 51.2、1.1 倍。整体而言，今日国债招标结果较好，加权收益率接近预测均值，全场倍数 2-4 倍。今日一级市场上铁道债受捧，10 年期品种中标利率为 3.15%，20 年期 3.42%，两期债对应投标倍数高达 5.22 倍和 5.55 倍。

今日国债期货高开低走，尾盘略有反弹，弱势收跌，10 年期国债期货主力合约 T1612 收报 100.975 元，涨 0.07%；5 年期国债期货主力合约 TF1612 收盘报 101.435 元，涨 0.03%。剩余期限为 9.56 年的国开债活跃券 160210 收益率报 3.16%/3.155%；剩余期限为 9.64 年的国债活跃券 160010 收益率报—%/2.77%。

今日人民币兑美元中间价报 6.6895 元，大幅下调 169 点。在岸人民币兑美元早盘快速走高，午后下调并窄幅波动，截止 16:30，在岸人民币兑美元收报 6.6711 元，较上一个交易日日盘收盘价涨 89 点；离岸人民币兑美元走势类似，现报 6.6748 元，较上个交易日收盘价涨 170 点，两岸汇差目前在 37 点左右；美元指数早盘震荡走高，午后回落，现报

95.60，涨 0.04%。据央行今日公布数据显示，8 月末外汇占款环比下降 1918.95 亿元，至 232483.50 亿元，为连续第 10 个月下滑。

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。