

市场概述

Market Overview

【每日市场动态 20161107】现券收益率小幅上行

文/ Zora Zhang

CFETS ICAP

CFETS-ICAP 2016/11/07

周一央行公开市场进行 200 亿 7 天逆回购操作，逆回购到期 1600 亿，资金净回笼 1400 亿；今日 Shibor 利率涨跌互现，短期利率持续回落。隔夜 Shibor 跌 2.6 个基点报 2.2060%；7 天 Shibor 跌 0.60 个基点报 2.3990%；14 天 Shibor 跌 0.30 个基点，报 2.5670%；1 个月 Shibor 与上日持平，报 2.7489%；3 个月 Shibor 涨 1.18 个基点，报 2.8576%。今日银行间市场资金面延续上周五的宽松态势，早盘便有各期限资金大量融出，午后继续供大于求，资金面全天维持均衡偏宽松态势。

今早发行的 3 年期、5 年期、7 年期、10 年期农发行固息增发债中标收益率分别为 2.7756%、2.9477%、3.1329%、3.1677%，全场倍数分别为 2.87、2.69、2.93、4.28 倍；整体而言，今日农发行债招标结果难言较好，各期限中标收益率均高于市场预期，投标倍数一般。今

日国债期货一路走低，大幅收跌，10 年期国债期货主力合约 T1612 收报 101.295 元，跌 0.23%；5 年期国债期货主力合约 TF1612 收盘报 101.770 元，跌 0.13%。现券今日再度调整，收益率一路上行，剩余期限 9.41 年的国开债活跃券 160210 收益率报 3.15%/3.145%；剩余期限 9.75 年的国债活跃券 160017 收益率报 2.7525%/2.75%。

周一人民币兑美元中间价报 6.7725 元，较上个交易日大幅下调 211 点。今早在岸人民币兑美元早盘走弱后维持横盘波动，午后再度走弱，截止 16:30，在岸人民币兑美元收报 6.7758 元，较上一个交易日日盘收盘价下跌 167 点；离岸人民币同样早盘走弱后横盘整理，现报 6.7848 元，较上个交易日收盘跌 112 个点，两岸汇差目前在 90 点附近；今日美元指数震荡走高，现报 97.67，涨 0.16%。

外汇交易中心今早公布数据显示，上

周五（11月4日）CFETS 人民币汇率指数为 93.78，按周跌 0.37；参考 BIS 货币篮子人民币汇率指数 94.67，按周跌 0.31；参考 SDR 货币篮子人民币汇率指数 94.95，按周跌 0.61。明天将举行美国总统选举，若希拉里大选获胜，将对美元提供一定支撑。

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。