

市场概述

Market Overview

【每日市场动态 20171113】10月金融数据低于预期

文/ Ryan Rui

CFETS-NEX 2017/11/13

今日中国公开市场进行了 800 亿元 7 天逆回购操作、700 亿元 14 天逆回购操作、300 亿元 63 天期逆回购操作，逆回购到期 300 亿，MLF 到期 665 亿，资金净投放 1500 亿元（不含 MLF）。Shibor 利率全线上涨，其中隔夜品种报 2.7870%，上涨 7.00 个基点；7 天品种报 2.8592%，上涨 1.37 个基点；1 个月品种报 4.0132%，上涨 0.28 个基点；3 个月品种报 4.5155%，上涨 4.08 个基点。今日资金面均衡稍紧，早盘隔夜资金融出有限，需求难以得到满足，午后融出增多，市场趋于均衡；7 天资金全天需求较大，但融出依旧有限，呈现偏紧态势。

央行下午公布金融数据显示，10 月金融数据全面低于预期，其中 M2 货币供应同比增速 8.8%，创历史新低，M1-M2 剪刀差延续收窄趋势；社会融资规模 10400 亿元人民币，新增人民币贷款 6632 亿元

人民币，均大幅低于预期和前值。

今日发行的 3 年期、5 年期农发行固息增发债中标收益率分别为 4.5445%、4.5917%，全场倍数分别为 3.23、3.50 倍。国债期货低开低走，尾盘跌幅扩大。10 年期国债期货主力合约 T1712 收报 92.105，下跌 0.65%，5 年期国债期货主力合约 TF1712 收报 95.670，下跌 0.34%。债券市场维持颓势，现券收益率大幅走高，十年国债、国开双双刷新前期新高，截至目前，剩余期限 9.79 年的国开债活跃券 170215 收益率报 4.69%/4.6825%；剩余期限 9.73 年的国债活跃券 170018 收益率报 3.98%/3.965%。目前债市情绪脆弱，尾盘的金融数据公布后，现券收益率短暂下行后便再度回升，短期或延续弱势震荡态势。

周一人民币兑美元中间价报 6.6347，较上个交易日下调 65 点。在岸人民币兑

美元早盘走弱后，跌幅逐渐收窄，截至 16:30，在岸人民币兑美元报收 6.6422，较上一交易日收盘价跌 22 点，创近两周新低；离岸人民币兑美元震荡走强，现报 6.6504，较上一交易日收盘价涨 100 点，两岸汇差目前在 100 点附近。美元指数走势偏强，现报 94.59，较上一交易日收盘价涨 0.22%。

上周五（11 月 10 日）CFETS 人民币汇率指数录得 95.05，按周下行 0.29；

参考 BIS 货币篮子的人民币汇率指数录得 95.94，按周下行 0.32，参考 SDR 货币篮子的人民币汇率指数录得 95.68，按周下行 0.39。

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-nex.com.cn

更多信息，请登录网站：www.cfets-nex.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。