

市场概述

Market Overview

【每日市场动态 20160708】6 月外汇储备意外增加

文/ Linda Zu

CFETS-ICAP 2016/07/08

今日央行公开市场进行了 200 亿元人民币七天期逆回购操作，中标利率持平于 2.25%；据此计算，本周净回笼 6450 亿元，创四个月以来单周新高。在公开市场单周净回笼逾 6000 亿后，银行间市场今日流动性依旧稳中稍宽，供需两旺之下主要回购利率变动不大。分析称，短期之内对资金影响较大的应该是陆续到期的 MLF，需要观望央行届时是否会续做。

银行间债市今日现券收益率略有反弹。在累积一定涨幅后，国债期货从高位回调，现货价格亦随之小幅走弱，但市场买盘力量不减。周经济数据预期亦偏弱，债市整体偏暖环境料将维持。周五剩余期限近 10 年的国开债 160210 券最新报价为 3.144%/3.1425%，上日尾盘在 3.1500%/3.1450%；剩余期限近 10 年的国债 160010 券最新报价为

2.8025%/2.7975%，上日尾盘在 2.8025%/2.7925%。中国金融期货交易所五年期国债期货主力合约 TF1609 周五尾盘收报 101.260 元，较上日结算价上涨 0.06%；10 年期国债主力合约 T1609 收报 100.690 元，较上日结算价上涨 0.06%。分析称，7 月初以来资金面宽松，资管机构、城商、农商银行等买盘力量强劲，债市资金整体充裕。预计后期流动性边际收紧的概率有限，随着实体经济走弱，多数机构一段时间内还将处于合意资产欠配状态，加之下半年非标资产到期规模较大，债市配置需求料将继续维持高位。

外汇市场方面，人民币兑美元即期今日小幅下跌，中间价也温和下调至 6.6853，上日中间价为 6.682。虽汇价波动较窄，但成交量上升。客盘结购汇基本均衡，略偏购汇。人民币兑美元即期

成交额为 131.79 亿美元，上日半日为 99.91 亿美元。海外无本金交割远期外汇（NDF）市场上，美元/人民币一年期品种报在 6.8435，上日尾盘为 6.8373。香港的离岸人民币兑美元即期报在 6.6974，上一交易日尾盘报 6.7008。全球汇市方面，美元兑多数主要货币小幅下跌，但周线料仍有望上涨。投资者都在等待今日稍晚将公布的美国非农就业数据，期望从中判断美国就业市场是否强于之前

调查显示的状况。市场避险情绪浓，多持观望态度，自营盘多选择减少隔夜头寸。若非农很好，料将对人民币形成较大影响。

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。