

市场概述

Market Overview

【每日市场动态 20161108】资金面维持宽松态势

文/ Zora Zhang

CFETS-ICAP 2016/11/08

周二央行公开市场共进行 400 亿逆回购操作，其中 7 天期 200 亿、14 天期 100 亿、28 天期 100 亿，逆回购到期 1850 亿，资金净回笼 1450 亿。今日 Shibor 利率涨跌互现。隔夜 Shibor 跌 1.9 个基点报 2.1870%，连续 7 个交易日下行；7 天 Shibor 跌 0.70 个基点报 2.3920%；14 天 Shibor 跌 0.20 个基点，报 2.5650%；1 个月 Shibor 跌 0.19 个基点，报 2.7470%；3 个月 Shibor 涨 0.72 个基点报 2.8648%。今日银行间市场资金面继续宽松，早盘便有隔夜和 7 天的资金大量融出，其他期限的资金也是供大于求，资金面全天维持均衡偏宽松态势。

海关总署今日公布数据，按美元计，中国 10 月出口同比下滑 7.3%，为连续第七个月下滑，差于预期的下滑 5.9%，前值为下滑 10%；10 月进口同比下滑 1.4%，也差于预期的下滑 1%，前值为下滑 1.9%；10 月贸易顺差 490.6 亿，预期 517 亿，

前值 419.9 亿。

今日发行的 1 年期、5 年期、10 年期、20 年期国开行固息债中标收益率分别为 2.35%、2.9153%、3.0975%、3.4025%，全场倍数分别为 2.46、2.99、5.49、2.65 倍，边际倍数分别为 1.8、1.49、1.24、2.05 倍；整体而言，今日国开行债招标结果一般，各期限中标收益率高于市场预期，投标倍数也一般。今日国债期货走势偏弱，10 年期国债期货主力合约 T1612 收报 101.240 元，跌 0.05%；5 年期国债期货主力合约 TF1612 收盘报 101.770 元，和上一交易日持平。现券收益率一路上行，午后略有下降，剩余期限 9.41 年的国开债活跃券 160210 收益率报 3.154%/3.1525%；剩余期限 9.74 年的国债活跃券 160017 收益率报 2.7725%/2.75%。

周二人民币兑美元中间价报 6.7817 元，较上个交易日大幅下调 92 点。今早

在岸人民币兑美元早盘走弱后维持横盘波动，午后小幅走强，截止 16:30，在岸人民币兑美元收报 6.7800 元，较上一个交易日日盘收盘价下跌 42 点；离岸人民币早盘走强，之后横盘震荡，现报 6.7920 元，较上个交易日收盘涨 20 个点，两岸汇差目前在 120 点附近；今日美元指数早盘震荡走高，午后下跌，现报 97.61，跌 0.15%。

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。