

市场概述

Market Overview

【每日市场动态 20161114】在岸人民币逾 7 年新低

文/ Ryan Rui

CFETS-ICAP 2016/11/14

央行公开市场今日进行 1050 亿 7 天期、650 亿 14 天期逆回购操作，逆回购到期 900 亿，资金净投放 800 亿；今日 Shibor 利率继续全线飘红，其中隔夜品种报 2.2310%，较上一交易日上涨 2 个基点，7 天品种报 2.4070%，涨 0.50 个基点，1 个月品种报 2.7508%，涨 0.32 个基点，3 个月品种报 2.8846%，涨 0.95 个基点。今日银行间市场资金面维持紧张态势，早盘隔夜、7 天资金融出有限，跨年品种交易有所增加，午后隔夜稍有融出，但依旧难以满足市场需求，全天维持偏紧态势。

今日统计局公布数据显示，1-10 月城镇固定资产投资同比增长 8.3%，好于预期，其中，民间投资增速连续第二个月再度加快；受汽车销售回落的影响，1-10 月社会消费品总额同比 10.3%，小幅不及预期；10 月规模以上工业增加值同

比 6.1%，较 9 月持平，略低于预期的 6.2%，表明当前工业增速比较稳定；此外，房地产调控初见成效，10 月商品房销售增速大幅放缓，不过房地产投资增速扩大。

今日国债期货一路走低，午后低位震荡，10 年期国债期货主力合约 T1703 收报 99.670 元，跌 0.21%；5 年期国债期货主力合约 TF1703 收盘报 100.765 元，跌 0.12%。现券收益率早盘略有下行，随后震荡走升，剩余期限 9.39 年的国开债活跃券 160210 收益率报 3.215%/3.21%；剩余期限 9.73 年的国债活跃券 160017 收益率报 2.88%/2.875%。

近期债券市场持续调整，其中 10 年国开收益率突破 3.20%，离 8 月底高点仅余 1BP 之差；而 10 年国债收益率则继续刷新 8 月底以来的新高；当前资金面稳中偏紧，资金价格维持高位，同时经济

企稳，通胀回升，黑色系商品价格持续走高，人民币汇率刷新逾 7 年新低；此外，美元美股深 V 跳涨，海外债市不断走弱；多重利空下，债市情绪偏弱，但随着调整的深入，配置力量或将逐渐涌现，预计短期债券市场维持震荡。

周一人民币兑美元中间价报 6.8291 元，较上一个交易日大幅下调 176 点，为连续第 7 日下调，刷新近 6 年半新低。在岸人民币兑美元早盘走弱后持稳，午后跌幅进一步扩大，连续跌破 6.83、6.84 关口，刷新逾 7 年新低，截止 16:30 收报 6.8409 元，较上一个交易日收盘收价大幅下挫 254 点，跌幅接近 0.40%；离岸人民币兑美元同样大幅走弱，跌破 6.85 关口，现报 6.8520 元，较上一个交易日收盘价大幅下跌 292 点，两

岸汇差目前在 100 点附近；美元指数涨幅扩大，强势走高，创 11 个月新高，现报 99.85，日内涨约 0.80%。

外汇交易中心今日公布数据显示，上周五（11 月 11 日）CFETS 人民币汇率指数为 94.33，按周涨 0.55。BIS 货币篮子人民币汇率指数报 95.51，按周涨 0.84；SDR 货币篮子人民币汇率指数报 95.11，按周涨 0.16。

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。