

市场概述

Market Overview

【每日市场动态 20161102】资金面维持宽松态势

文/ Zora Zhang

CFETS-ICAP 2016/11/02

周三央行公开市场共进行 1200 亿逆回购操作，其中 7 天期 800 亿、14 天期 300 亿、28 天期 100 亿，逆回购到期 1550 亿，资金净回笼 350 亿，为两周内首次净回笼。今日 Shibor 利率短跌长涨，隔夜 Shibor 跌 0.28 个基点报 2.2492%；7 天 Shibor 跌 0.2 个基点报 2.4140%；14 天 Shibor 与上日持平，报 2.5730%；1 个月 Shibor 涨 0.23 个基点报 2.7509%；3 个月 Shibor 涨 0.42 个基点报 2.8296%。今日银行间市场资金面继续保持宽松，早盘就有大行融出隔夜和 7 天资金，需求能够得到满足。午后各期限资金仍维持均衡偏松态势。

今早发行的 30 年期国开行固息增发债中标收益率为 3.5%，全场倍数为 3.2 倍，边际倍数为 1.06 倍。此外，财政部发行的 1 年期和 10 年期固息国债加权中标收益率分别为 2.1% 和 2.7%，边际收益率分别为 2.14% 和 2.73%，全场倍数分别

3.12 倍和 3.39 倍。整体而言，今日国开行债和国债招标平稳，体现需求稳中向好，投标倍数超 3 倍。今日 10 年期国债期货主力合约 T1612 收报 101.365 元，涨 0.03%；5 年期国债期货主力合约 TF1612 收盘报 101.825 元，涨 0.07%。今日现券收益率早盘略有上行，之后维持稳定，剩余期限 9.43 年的国开债活跃券 160210 收益率报 3.14%/3.138%；剩余期限 9.76 年的国债活跃券 160017 收益率报 2.74%/2.735%。

周二人民币兑美元中间价报 6.7562 元，较昨日上涨 172 点，升至近两周新高。在岸人民币兑美元早盘小幅震荡，午后小幅下跌后再度走强，截止 16:30，在岸人民币兑美元收报 6.7613 元，较上一个交易日收盘收价涨 131 点。离岸人民币全天震荡，现报 6.7718 元，较上一个交易日收盘涨 17 个点，两岸汇差目前在 105 点附近；今日美元指数走势偏弱，

现报 97.45，跌 0.3%。周四凌晨 02:00，
美联储将宣布利率决定并发表政策声明，
市场静待决议结果。

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。