

市场概述

Market Overview

CFETS ICAP

【每日市场动态 20160119】资金供给稍显紧俏

文/ Linda Zu

CFETS-ICAP 2016/01/19

1. 财经要闻

(1) 央行决定自 2016 年 1 月 25 日起，对境外金融机构在境内金融机构存放执行正常存款准备金率政策。此前存款准备金率暂定为零。对境外金融机构境内存放执行正常存款准备金率，这一措施不会影响境内人民币流动性，将综合运用各种货币政策工具保持银行体系流动性合理充裕。

(2) 央行进行 550 亿 SLO。中国央行：1 月 18 日以利率招标方式开展了 550 亿元短期流动性调节工具（SLO）操作，期限为 3 天，中标利率 2.10%。

(3) 12 月金融机构外汇占款创历史第二大降幅。据央行数据，中国金融机构口径 12 月末人民币外汇占款环比下降 6289.82 亿元，至 26.6 万亿人民币，为历史第二大降幅。这是在经历 10 月份短暂回升之后，机构口径外汇占款连续第二个月下降。

2. 市场动态

(1) 资金面有所收紧。周一隔夜质押式回购加权平均利率为 1.9353%，上日为 1.9361%；7 天品种为 2.3316%，上日为 2.3302%。尽管资金利率波动不大，但资金面周一有所收紧，不少机构直至收盘头寸仍然未平。

(2) 周一利率债整体上行，国债曲线收益率除个别期限外，整体上行 1-3BP。午后农发新发 2 年期，增发 3、5、7、10 年，招标收益率较前一日市场收益率偏高。截止日终，国开行整体上行 2-4BP，政策性银行曲线（农发行和进出口行）除个别期限外，整体上行 2-4BP。

(3) 香港 3 个月期 HIBOR 升至 2010 年 7 月以来最高。3 个月期香港银行间同业拆息(Hibor)上涨 3 个基点至 0.44871%，至 2010 年 7 月以来最高。1 个月期 Hibor 上涨 4 个基点至 0.26752%，为 2013 年 1 月以来最高。

3. 评级变动

无

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。