

市场概述

Market Overview

【每日市场动态 20161103】人民币中间价继续上涨

文/ Zora Zhang

CFETS-ICAP 2016/11/03

周四央行公开市场共进行 700 亿逆回购操作，其中 7 天期 300 亿、14 天期 200 亿、28 天期 200 亿，逆回购到期 1650 亿，资金净回笼 950 亿，为连续第二天实现净回笼。今日 Shibor 利率仍短跌长涨，但短期品种跌幅扩大。隔夜 Shibor 跌 0.42 个基点报 2.2450%；7 天 Shibor 跌 0.60 个基点报 2.4080%；14 天 Shibor 跌 0.10 个基点，报 2.5720%；1 个月 Shibor 跌 0.19 个基点报 2.7490%；3 个月 Shibor 涨 0.84 个基点报 2.8380%。今日银行间市场资金面较昨日更为宽松，各期限供大于求，午盘以后，仍有隔夜融出，全天资金维持宽松态势。

今早发行的 3 年进出口行固息债中标收益率为 2.8%，全场倍数为 1.89 倍，边际倍数为 2.82 倍。此外，5 年期、10 年期和 20 年期进出口行固息增发债的中标收益率分别为 2.9413%、3.1502% 和 3.4334%，全场倍数分别为 2.14、3.54

和 2.40 倍。整体而言，今日进出口行债招标结果平稳，中标利率略高于预测均值，投标倍数一般。今日 10 年期国债期货主力合约 T1612 收报 101.53 元，涨 0.18%；5 年期国债期货主力合约 TF1612 收盘报 101.91 元，涨 0.11%。今日现券收益率窄幅震荡，收益率变动不大。剩余期限 9.42 年的国开债活跃券 160210 收益率报 3.13%/3.128%；剩余期限 9.76 年的国债活跃券 160017 收益率报 2.73%/2.7225%。

周四人民币兑美元中间价报 6.7491 元，较昨日上涨 71 点，创下过去两周内的最高值。在岸人民币兑美元早盘随中间价缩量走升，之后窄幅震荡，临近收盘再度走强，截止 16:30，在岸人民币兑美元收报 6.7608 元，较上一个交易日收盘收盘价涨 5 点。离岸人民币全天震荡上行，现报 6.7720 元，较上个交易日收盘跌 43 点，两岸汇差目前在 112 点附近；

今日美元指数早盘延续跌势，午后收复部分失地，现报 97.27，跌 0.11%。在美联储加息预期提振下，美元指数 10 月份大涨 3%，但过去一周，随着美国总统大选选情生变，美元指数承压下行，大选结果的不确定性令投资者更倾向于观望，美元指数短期内可能步入休整期。

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。