

市场概述

Market Overview

【晨报 20161102】

文/ Ryan Rui

CFETS ICAP

CFETS-ICAP 2016/11/02

1. 财经新闻

(1) SLF 利率发挥利率走廊上限作用，维护货币市场利率平稳。央行昨日公布数据显示，10 月对国开行、农发行、进出口银行三家银行净增加抵押补充贷款共 511 亿元，10 月末抵押补充贷款余额为 19756 亿元；10 月对金融机构开展中期借贷便利操作共 7630 亿元，10 月末中期借贷便利余额为 21118 亿元；10 月对金融机构开展常备借贷便利操作共 7.12 亿元，10 月末常备借贷便利余额为 5 亿元。

(2) 美国 10 月制造业 PMI 创一年新高。美国供应管理协会（ISM）昨晚公布数据显示，美国 10 月 ISM 制造业指数 51.9，好于预期。其中，物价支付指数由 9 月的 53 升至 54.5，新订单指数由 9 月的 55.1 下降至 52.1。此外公布的另一项数据显示，美国 10 月 Markit 制造业

PMI 终值 53.4，创 2015 年 10 月以来新高，好于预期的 53.2，初值为 53.2；9 月终值为 51.5。

(3) 特朗普支持率反超希拉里。ABC News/Washington Post 民调周二显示，特朗普支持率为 46%，反超希拉里 45% 一个百分点。该调查是在 10 月 27 日至 30 日期间进行的，覆盖了 10 月 29 日，FBI 宣布重启希拉里电邮案调查的时间段。此外，洛杉矶时报/USC 的最新民调显示，特朗普支持率反超希拉里 4 个百分点。而在上周四，希拉里的平均民调支持率一度领先 5.6 个百分点。

2. 市场动态

(1) 周二央行公开市场共进行 1900 亿逆回购操作，逆回购到期 1550 亿，资金净投放 350 亿，今日同样有 1550 亿逆回购到期。昨日资金面继续好转，早盘即有大行融出隔夜、7 天期限，除此之外，

亦有部分非银和银行加点融出隔夜、7 天等期限，略有交投，午盘以后，资金持续偏松的状态，有股份制银行融出隔夜 7 天资金。隔夜、7 天、14 天回购收盘加权利率分别在 2.3306%、2.7343%、3.0279%，交易量较上一交易日增加 16.58%。

(2) 据中国外汇交易中心数据，周二在岸人民币兑美元夜盘小幅走强，北京时间 23:30 收报 6.7680 元，较前一个交易日夜盘收盘价上涨 102 点，在岸人民币兑美元全天成交量缩减至 290.30 亿美元。

3. 一级市场

今日银行间市场有 16 付息国债 23 (计划发行规模 260 亿) 等国债 2 只；16 中信 CD351 (计划发行规模 10 亿，票面利率 3.06%) 等同业存单 94 只；16 国

开 16 (计划发行规模 100 亿) 等金融债 1 只；16 泉州城投小微债 01 (计划发行规模 7 亿) 等企业债 3 只；16 中化工 MTN001 (计划发行规模 25 亿) 等中期票据 10 只；16 吉利 SCP013 (计划发行规模 5 亿) 等短期融资券 10 只；16 加拿大人民币债 01 (计划发行规模 35 亿) 等国际机构债 1 只；共计 121 只债券发行，计划发行额 1311.10 亿。

4. 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。