

市场概述

Market Overview

【每日市场动态 20160804】人民币中间价波幅增大

文/ Ryan Rui

CFETS-ICAP 2016/08/04

央行公开市场今日进行 500 亿 7 天期逆回购操作，到期 800 亿，资金净回笼 300 亿；今日 Shibor 利率继续全线走低，隔夜品种报 2.0020%，较上一交易日下跌 0.2 个基点，7 天品种报 2.3240%，下跌 0.8 个基点，1 个月品种报 2.7390%，下跌 1.6 个基点，3 个月品种报 2.8220%，下跌 1.15 个基点。今日银行间市场资金面延续前两日的均衡偏松，大行、股份制银行融出隔夜，供求均衡，7 天及以上品种供给充足，主要回购利率波动幅度有限。央行昨日召开分支行行长座谈会表示，继续实施稳健的货币政策，适时预调微调，增强有效性和针对性。8 月以来，央行持续净回笼资金，但资金面宽松格局不改，短期内无缴税等制约流动性的因素，资金面料延续平稳偏松。

今日国债期货窄幅震荡，小幅收高，10 年期国债期货主力合约 T1609 收盘报

101.210 元，涨 0.06%；5 年期国债期货主力合约 TF1609 收盘报 101.580 元，涨 0.02%。现券走势依然不明朗，追随国债期货窄幅波动，收益率变动不大，截止到目前，剩余期限 9.67 年的国开债活跃券 160210 收益率报 3.1595%/3.1585%；剩余期限 9.76 年的国债活跃券 160010 收益率报 2.77%/2.765%。下周 CPI 等多项重量级数据集中公布，机构比较谨慎，现券走势分歧较大，短期料难逃震荡格局。

今日人民币兑美元中间价报 6.6444 元，大幅下调 249 点，创近一个月以来最大调降幅度。在岸人民币兑美元早盘随中间价走弱后窄幅波动，截止 16:30 时，人民币兑美元收盘报收 6.6392 元，较昨日收盘价下挫 84 点；离岸人民币兑美元早盘走升后回吐所有涨幅，现报 6.6458 元，较昨日收盘价下跌 30 点，

离岸、在岸汇差目前约在 43 点左右；昨晚美国小非农数据好于预期，美元指数反弹回升，现报 95.27，涨 0.19%。今晚英国央行将宣布政策决定，市场预测基准利率将被降至纪录低点，同时明晚美国还有非农、贸易帐等数据公布，人民币汇率弹性料将进一步增强。

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。