

市场概述

Market Overview

【晨报 20160704】

文/ Ryan Rui

CFETS ICAP

CFETS-ICAP 2016/07/04

1. 财经新闻

(1) 新华社昨日发表评论称，站在年中节点观察，复苏疲弱风险凸显，应是当下世界经济的最主要特点。从五个主要问题加以探讨，更说明对遭遇“黑天鹅”事件的世界经济而言，一个增长稳定、结构优化、民生托底的中国经济对全球意义更加重大。

(2) 保监会近日对《保险资金间接投资基础设施项目试点管理办法》进行修订，在防范风险的前提下，放宽保险资金可投资基础设施项目的行业范围，增加政府和社会资本合作（即 PPP 模式）等可行投资模式。

(3) 中国央行周五晚公布数据显示，6 月份对金融机构开展常备借贷便利操作（SLF）共 27.2 亿元，其中隔夜 27.1 亿元，利率为 2.75%；七天 0.1 亿元，利率为 3.25%。6 月末常备借贷便利余额为 20

亿元。6 月份对金融机构开展中期借贷便利操作（MLF）共 2080 亿元，其中期限 3 个月 1232 亿元、6 个月 115 亿元、1 年期 733 亿元，利率分别为 2.75%、2.85%、3.0%。同时收回到期中期借贷便利 1000 亿元。6 月末中期借贷便利余额为 17455 亿元。6 月份对三家政策性银行净增加抵押补充贷款（PSL）共 1719 亿元，6 月末 PSL 款余额为 16718.89 亿元。

(4) 今日中国外汇交易中心数据显示，上周五（7 月 1 日）CFETS 人民币汇率指数为 94.88，按周跌 0.41，再创纪录新低。参考 BIS 货币篮子的人民币汇率指数为 95.87，较前周五（6 月 24 日）下降 0.62，参考 SDR 货币篮子的人民币汇率指数为 95.69，较前周五上涨 0.47。

2. 市场动态

(1) 上周五央行进行公开市场操作 500 亿，逆回购到期 1700 亿，本周共有

8400 亿逆回购到期，其中今日到期 2700 亿，周二到期 1800 亿，周三到期 2100 亿，周四到期 1300 亿，周五到期 500 亿。上周五资金供给明显宽松，大行和农商融出隔夜，需求基本立即可以得到满足，银行间隔夜、7 天、14 天回购收盘加权利率分别在 2.0198%、2.3759%、2.8083%，交易量较上一个交易日增长 43.35%。

(2) 据中国外汇交易中心数据，上周五夜盘在岸人民币兑美元小幅走高，北京时间 23:00 收报 6.6558 元，在岸人民币兑美元全天成交量缩减至 179.79 亿美元。

3. 一级市场

今日银行间市场有 16 浦发 CD255（计划发行规模 113.50 亿，票面利率 2.75%）等同业存单 45 只；16 农发 13（增发）

（计划发行规模 100 亿）等金融债 4 只；16 临川城投债（计划发行规模 15 亿）等企业债 1 只；16 华强 MTN001（计划发行规模 8 亿）等中期票据 1 只；16 徐工 SCP003（计划发行规模 31 亿）等短期融资券 10 只；共计 61 只债券发行，计划发行额 1021.90 亿。

4. 评价变动

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。