

市场概述

Market Overview

【晨报 20160316】

文/ Ryan Rui

CFETS ICAP

CFETS-ICAP 2016/03/16

1. 财经新闻

(1) 商务部昨日公布数据显示，我国 1-2 月非金融类对外直接投资 299.2 亿美元，同比增长 71.8%。对外直接投资有四个主要特点，行业分布广泛、“一带一路”建设和国际产能合作加快推进、投资地区高度集中、地方企业对外投资势头迅猛。

(2) 美国财政部昨日发布的国际资本流动报告 (TIC) 显示，外国政府和央行 1 月净卖出长期美国国债规模达到 572 亿美元，创纪录新高。中国 1 月再度减持美债 82 亿美元，持有的美债规模为 1.24 万亿美元，刷新 10 个月新低。日本 1 月所持美债 1.12 万亿美元，较 12 月增持 9 亿美元。

(3) 住建部部长陈政高昨日回应“中国楼市是否会像日本一样发生崩盘”称：第一，时代不同。日本发生的事情是在 20 年、30 年以前的事情，背景、政

治、经济条件和今天都大不一样，甚至是完全不一样了。第二，国情不同。中国和日本的城镇化水平不同，经济发展阶段不同，宏观调控的措施也不同。因此，不能相提并论。

(4) 昨日公布的数据显示，美国 2 月 PPI 同比 0.0%，低于预期值 0.1%，高于前值-0.2%，2 月 PPI 环比-0.2%，与预期保持一致，低于前值 0.1%；2 月踢出食品和能源价格的核心 PPI 同比 1.2%，与预期保持一致，高于前值 0.6%。2 月核心 PPI 环比 0.0%，低于预期值 0.1%和前值 0.4%。

(5) 日本央行昨日下午称，政策利率维持在-0.1%不变，货币基础年增幅目标维持在 80 万亿日元不变。日本经济正处于良性循环中。如有必要日本央行将采取额外的宽松措施。更多的宽松措施可能是从量化、质化和利率三个方面来行动。

2. 市场动态

(1) 昨日央行进行公开市场操作 200 亿，逆回购到期 300 亿，资金净回笼 100 亿，今日有 150 亿逆回购到期。整体而言，昨日资金延续宽松状态，市场需求基本得到满足。隔夜回购加权利率降低了 0.6 个基点，7 天回购加权利率增加了 0.18 个基点。预计近期央行继续小量逆回购操作，资金面以稳为主。

(2) 据中国外汇交易中心数据，在岸人民币兑美元昨日夜盘交易中跌幅有所扩大，北京时间 23:30 交易结束时报 6.5120 元，较上个交易日夜盘结束时下跌 0.2%；在岸人民币兑美元全天成交量下降至 160.3 亿美元。

3. 一级市场

今日银行间市场有 16 附息国债 06（计划发行规模 200 亿）等国债 1 只；16 建行 CD001（计划发行规模 10 亿，票

面利率 2.65%）等同业存单 70 只；16 农发 07（增 2）（计划发行规模 70 亿）等金融债 7 只；16 资阳水务（计划发行规模 19 亿）等企业债 4 只；16 舟山海洋 MTN001（计划发行规模 10 亿）等中期票据 8 只；16 北京国资 SCP002（计划发行规模 20 亿）等短期融资券 30 只；16 惠金（1A 计划发行规模 16.9 亿，1B 计划发行规模 2.1 亿，1C 计划发行规模 3.57）等资产抵押证券 1 只；共计 123 只债券发行，计划发行额 1942.67 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。