

市场概述

Market Overview

【晨报 20160811】

文/ Ryan Rui

CFETS ICAP

CFETS-ICAP 2016/08/11

1. 财经新闻

(1) 央行昨日发布《2016 年人民币国际化报告》称，展望未来人民币国际化的基础设施将进一步完善，经常项目人民币跨境使用将进一步扩大，人民币跨境投融资渠道将进一步拓宽，双边货币合作将继续稳步开展，人民币作为储备货币规模将进一步增加。

(2) 银监会昨日公布数据显示，二季度末，商业银行不良贷款余额 14373 亿元，较上季末增加 452 亿元，商业银行不良贷款率 1.75%，与上季末持平，商业银行贷款拨备率为 3.07%，拨备覆盖率为 175.96%，加权平均核心一级资本充足率为 10.69%，商业银行关注类贷款余额 3.3 万亿元人民币，人民币超额备付金率较上季末上升 0.22，上半年商业银行净利润 8991 亿元人民币，同比增长 3.17%。

(3) 保监会近日下发风险综合评级

评价标准征求意见稿，意见稿提到，每季度结束后 25 日内，保险公司应当向保监会报送操作风险、声誉风险、战略风险、流动性风险分类监管信息和数据。每季度结束后 10 个工作日内，保险公司应当向保监会报送信息系统操作风险各项评价指标的指标值和有关信息。

(4) 上海市政府官网昨日发布财政改革与发展“十三五”规划明确，要积极探索在自贸区内发行上海地方债；同时称，“十二五”规划确定的目标任务顺利完成，这将成为偿债的主要保障。

2. 市场动态

(1) 昨日央行进行公开市场操作 800 亿，逆回购到期 550 亿，今日有 500 亿逆回购到期。周三资金面整体紧张，早盘延续前几日紧张的状况，极少数机构融出隔夜，需求无法立马可以得到满足，很多机构到下午才借平头寸，14 天及以

上供求充足。隔夜、7 天、14 天回购收盘加权利率分别在 2.0666%、2.5327%、2.7582%，交易量较上个交易日降低 5.74%。

(2) 据中国外汇交易中心数据，昨日在岸人民币兑美元夜盘大幅上涨，北京时间 23:30 收报 6.6400 元，较上个交易日夜盘收盘价上扬 204 点，在岸人民币兑美元全天成交量增长至 205.71 亿美元。

3. 一级市场

今日银行间市场有 16 山西债 16（计划发行规模 49.00 亿）等地方政府债 6 只；16 农行 CD017（计划发行规模 25 亿，票面利率 2.72%）等同业存单 61 只；16

进出口 09（计划发行规模 50 亿）等金融债 3 只；16 豫高管 MTN001（计划发行规模 20 亿）等中期票据 4 只；16 晋焦煤 SCP002（计划发行规模 15 亿）等短期融资券 20 只；共计 94 只债券发行，计划发行额 1105.56 亿。

4. 评级变动

上调桐乡城市建设投资有限公司主体评级由 AA 至 AA+（鹏元资信）；

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。